PIMCO

PIMCO FUNDS: GLOBAL INVESTORS SERIES PLC

Halbjahresbericht

30. Juni 2023

A company of Allianz

Eine offene Anlagegesellschaft mit variablem Kapital, gesonderter Haftung zwischen den Fonds und beschränkter Haftung gemäß dem Companies Act 2014, die unter der Register-Nr. 276928 eingetragen und von der irischen Zentralbank Central Bank of Ireland nach den Rechtsvorschriften der Europäischen Gemeinschaften von 2011 (Richtlinie betreffend Organismen für die gemeinsame Anlage in Wertpapiere [„OGAW"]) (in der jeweils geltenden Fassung) genehmigt wurde.

ALLGEMEINE KENNDATEN

Fondstyp:
OGAW

Anzahl an Fonds der Gesellschaft:
56 Fonds

Zum 30. Juni 2023 angebotene Anteilsklassen der Gesellschaft:*
Institutional
Institutional AUD (Hedged)
Institutional BRL (Hedged)
Institutional CAD (Hedged)
Institutional CHF (Hedged)
Institutional CHF (Partially Hedged)
Institutional CZK (Hedged)
Institutional EUR (Currency Exposure)
Institutional EUR (Hedged)
Institutional EUR (Partially Hedged)
Institutional EUR (Unhedged)
Institutional GBP (Currency Exposure)
Institutional GBP (Hedged)
Institutional GBP (Partially Hedged)
Institutional GBP (Unhedged)
Institutional HKD (Unhedged)
Institutional ILS (Hedged)
Institutional JPY (Hedged)
Institutional MXN (Hedged)
Institutional NOK (Hedged)
Institutional NOK (Partially Hedged)
Institutional NZD (Hedged)
Institutional PLN (Hedged)
Institutional RMB (Hedged)
Institutional SEK (Hedged)
Institutional SGD (Hedged)
Institutional USD (Currency Exposure)
Institutional USD (Hedged)
Investor
Investor AUD (Hedged)
Investor CAD (Hedged)
Investor CHF (Hedged)
Investor EUR (Hedged)
Investor EUR (Unhedged)
Investor GBP (Hedged)
Investor JPY (Hedged)
Investor NOK (Hedged)
Investor RMB (Hedged)
Investor SEK (Hedged)
Investor SGD (Hedged)
Investor USD (Hedged)
Administrative
Administrative AUD (Hedged)
Administrative CHF (Hedged)
Administrative EUR (Hedged)
Administrative GBP (Hedged)
Administrative HKD (Unhedged)
Administrative JPY (Hedged)
Administrative SEK (Hedged)
Administrative SGD (Hedged)
BE Retail
BM Retail
BM Retail AUD (Hedged)
BM Retail USD (Hedged)
BN Retail
E Class
E Class AUD (Hedged)
E Class AUD (Partially Hedged)
E Class CHF (Hedged)
E Class EUR (Currency Exposure)
E Class EUR (Hedged)
E Class EUR (Partially Hedged)
E Class EUR (Unhedged)
E Class GBP (Hedged)
E Class GBP (Partially Hedged)
E Class HKD (Unhedged)
E Class JPY (Hedged)
E Class NOK (Hedged)
E Class RMB (Hedged)
E Class SGD (Hedged)
E Class SGD (Partially Hedged)
E Class USD (Currency Exposure)
E Class USD (Hedged)
G Retail EUR (Hedged)
G Retail EUR (Unhedged)
H Institutional
H Institutional EUR (Hedged)
H Institutional USD (Currency Exposure)
H Institutional USD (Hedged)
M Retail
M Retail AUD (Hedged)
M Retail HKD (Unhedged)
M Retail SEK (Hedged)
M Retail SGD (Hedged)
M Retail USD (Hedged)
N Retail
R Class
R Class AUD (Hedged)
R Class EUR (Hedged)
R Class GBP (Hedged)
T Class
T Class EUR (Hedged)
T Class USD (Hedged)
W Class
W Class CAD (Hedged)
W Class CHF (Hedged)
W Class EUR (Hedged)
W Class GBP (Hedged)
W Class NOK (Hedged)
W Class SEK (Hedged)
W Class SGD (Hedged)
W Class USD (Currency Exposure)
Z Class
Z Class AUD (Hedged)
Z Class EUR (Hedged)
Z Class GBP (Hedged)

Anteilsarten:
Innerhalb jeder Klasse darf die Gesellschaft, vorbehaltlich der jeweiligen Ergänzung, ausschüttende Anteile (Gewinne ausschüttende Anteile), thesaurierende Anteile (Gewinne thesaurierende Anteile) und/oder Ausschüttend-II-Anteile (Anteile, die eine höhere Rendite erzielen sollen) ausgeben.

Nettovermögen (Angaben in Tausend):
158.304.274 USD

Mindestbestand:
Die Mindestbeteiligung für die Anteilsklassen Institutional, Investor, Administrative, H Institutional und W Class liegt bei 500.000 USD oder dem Gegenwert in der Währung der jeweiligen Anteilsklasse. Die Mindestbeteiligung für die Anteilsklassen BE Retail Class, BM Retail Class, BN Retail Class, E Class, G Retail, M Retail, N Retail, R Class und T Class liegt bei 1.000 USD oder bei Bedarf beim Gegenwert in der Währung der jeweiligen Anteilsklasse. Die Mindestbeteiligung für

ALLGEMEINE KENNDATEN (Forts.)

die Z-Klassen liegt bei 20 Mio. USD oder dem Gegenwert in der Währung der jeweiligen Anteilsklasse. Die Pacific Investment Management Company LLC („PIMCO“) ist nach eigenem Ermessen befugt, auf das Erfordernis der Mindestanfangszeichnung und des Mindestbestandes gemäß dem aktuellen Verkaufsprospekt zu verzichten.

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

Ungeachtet der vorangehenden Ausführungen ist ein Tag für einen Fonds kein Handelstag, wenn es entweder aufgrund von Feiertagen oder einer Markt- bzw. Börsenschließung in jeglichem Rechtsgebiet schwierig ist, (i) einen Fonds zu verwalten oder (ii) einen Teil des Fondsvermögens zu bewerten. Anteilinhaber und potenzielle Anleger können weitere Einzelheiten über geplante Schließungen von Fonds während des Jahres beim Administrator erfragen oder sie im Feiertagskalender der Fonds finden (eine Kopie desselben kann beim Administrator angefordert werden).

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

ALLGEMEINE KENNDATEN (Forts.)

Zulassung in Hongkong:

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

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

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

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

Zulassung in Singapur

Diese Fonds werden von der Monetary Authority of Singapore gemäß dem Securities and Futures Act, Kapitel 289 von Singapur, nicht anerkannt und stehen Privatanlegern in Singapur nicht zur Verfügung:

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

Reuters-Seite:

PAFPPLC

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

Inhaltsverzeichnis

	Seite
Marktkenntnisse*	4
Wichtige Angaben zu den Fonds	5
Beschreibungen der Vergleichsindizes	68
Finanzstatus	74
Betriebsergebnisrechnung	94
Ausweis der Nettovermögensänderungen	114
Aufstellung des Wertpapierbestands	120
Erläuterungen zum Abschluss	738
Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung	798
Glossar	856
Allgemeine Informationen	858

FONDS	Fonds-überblick*	Aufstellung des Wertpapierbestands
PIMCO Asia High Yield Bond Fund	7	120
Asia Strategic Interest Bond Fund	8	129
PIMCO Capital Securities Fund	9	137
PIMCO Climate Bond Fund	11	145
Commodity Real Return Fund	12	153
PIMCO Credit Opportunities Bond Fund	13	163
Diversified Income Fund	14	172
Diversified Income Duration Hedged Fund	16	189
Diversified Income ESG Fund	17	199
Dynamic Bond Fund	18	206
Dynamic Multi-Asset Fund	19	223
Emerging Local Bond Fund	20	234
Emerging Local Bond ESG Fund	21	250
Emerging Markets Bond Fund	22	258
Emerging Markets Bond ESG Fund	23	274
Emerging Markets Corporate Bond Fund	24	288
PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund	25	296
Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund	26	310
PIMCO ESG Income Fund	27	321
Euro Bond Fund	28	333
Euro Credit Fund	29	341
Euro Income Bond Fund	30	347
Euro Long Average Duration Fund	31	356
Euro Short-Term Fund	32	362
PIMCO European High Yield Bond Fund	33	367
PIMCO European Short-Term Opportunities Fund	34	373
Global Advantage Fund	35	379
Global Bond Fund	36	397
Global Bond ESG Fund	38	422
Global Bond Ex-US Fund	39	439
PIMCO Global Core Asset Allocation Fund	40	455
Global High Yield Bond Fund	41	468
Global Investment Grade Credit Fund	42	478
Global Investment Grade Credit ESG Fund	44	499
Global Low Duration Real Return Fund	45	513
Global Real Return Fund	46	521
Income Fund	47	531
Income Fund II	49	569
Inflation Multi-Asset Fund	50	576
Low Average Duration Fund	51	585
Low Duration Global Investment Grade Credit Fund	52	593
Low Duration Income Fund	53	602

FONDS	Fonds-überblick*	Aufstellung des Wertpapierbestands
Low Duration Opportunities Fund	54	616
Low Duration Opportunities ESG Fund	55	627
PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund	56	630
Mortgage Opportunities Fund	57	633
StocksPLUS™ Fund	58	642
PIMCO StocksPLUS™ AR Fund	59	649
Strategic Income Fund	60	654
Total Return Bond Fund	61	671
PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund	62	684
UK Corporate Bond Fund	63	700
UK Long Term Corporate Bond Fund	64	707
US High Yield Bond Fund	65	713
US Investment Grade Corporate Bond Fund	66	721
US Short-Term Fund	67	731

Dieser Halbjahresbericht kann in andere Sprachen übersetzt werden. Diese Übersetzungen dürfen ausschließlich dieselben Informationen wie der englischsprachige Halbjahresbericht enthalten und müssen dieselbe Bedeutung haben. Soweit zwischen dem englischsprachigen Halbjahresbericht und dem Halbjahresbericht in einer anderen Sprache Abweichungen bestehen, hat der englischsprachige Halbjahresbericht Vorrang, es sei denn, es ist in irgendeinem Rechtsgebiet, in dem die Anteile verkauft werden, gesetzlich vorgeschrieben, dass bei einer Klage, die auf Angaben in einem Halbjahresbericht in einer anderen Sprache als Englisch beruht, die Sprache des Halbjahresberichts, auf der diese Klage beruht, maßgeblich ist. Etwaige Streitigkeiten bezüglich der Bedingungen des Halbjahresberichts unterliegen unabhängig von der Sprache des Halbjahresberichts irischem Recht und werden in Übereinstimmung mit diesem ausgelegt.

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

Marktkenntnisse

Sehr geehrte Anteilinhaber,

Dieser Halbjahresbericht behandelt den sechsmonatigen Berichtszeitraum zum 30. Juni 2023 (der „Berichtszeitraum“). Auf den folgenden Seiten finden Sie Einzelheiten zu den Anlageergebnissen sowie eine Erörterung der Faktoren, die die Wertentwicklung während des Berichtszeitraums beeinflussten.

Vor dem Hintergrund einer erhöhten Inflation in vielen Ländern während des Berichtszeitraums sah sich die Weltwirtschaft mit Herausforderungen konfrontiert, die auf höhere Zinssätze, verschärfte Kreditbedingungen aufgrund der Turbulenzen im Bankensektor (insbesondere in den Vereinigten Staaten („USA“) und geopolitische Sorgen zurückzuführen waren. Während die US-Wirtschaft Anzeichen von Widerstandsfähigkeit zeigte, verzeichneten einige europäische Volkswirtschaften im Berichtszeitraum ein langsameres Wachstum.

Anhaltende Maßnahmen der Zentralbanken zur Bekämpfung der Inflation

Während die Inflation während des Berichtszeitraums weiterhin hoch blieb, hoben viele Zentralbanken die Zinssätze an, um die steigenden Preise einzudämmen. Die US-Notenbank Federal Reserve (die „Fed“) hob den Leitzins bei zehn aufeinanderfolgenden Sitzungen an, und zwar von März 2022 bis Mai 2023. Im Juni 2023 setzte die Fed dann die Zinsanhebung aus, um „weitere Informationen und ihre Auswirkungen auf die Geldpolitik zu beurteilen“. Indes hoben die britische Zentralbank Bank of England und die Europäische Zentralbank die Zinssätze zum 13. bzw. achten Mal in Folge zum Juni 2023 an. Im Gegensatz dazu behielt die japanische Zentralbank Bank of Japan ihre expansive Geldpolitik bei.

Gemischte Renditen an den Finanzmärkten

Die Rendite der maßgeblichen 10-jährigen US-Staatsanleihen sank im Berichtszeitraum, wohingegen die Renditen 10-jähriger Anleihen in den meisten anderen Industrieländern stiegen. Insgesamt erzielte der globale Markt für Kreditanleihen positive Gesamtrenditen. Globale Anleihen mit höherem Rating entwickelten sich schlechter als Anleihen mit niedrigerem Rating. Während sich die globalen Aktien im Höhenflug befanden, waren die Rohstoffpreise volatil und erzielten gemischte Renditen. Der US-Dollar verlor gegenüber dem Euro und dem britischen Pfund an Wert, gewann dagegen jedoch gegenüber dem japanischen Yen an Wert.

Angesichts der sich fortlaufend verändernden Bedingungen arbeiten wir weiterhin unermüdlich daran, uns auf den Märkten zu orientieren und die Vermögenswerte zu verwalten, die Sie uns anvertraut haben. Bitte sprechen Sie mit Ihrem Finanzberater über Ihre Ziele und besuchen Sie die Website global.pimco.com, um sich über unsere neuesten Erkenntnisse zu informieren.

Mit freundlichem Gruß

Craig A. Dawson
Vorsitzender

Gesamtrenditen bestimmter Anlageklassen für den Berichtszeitraum bis zum 30. Juni 2023

Anlageklasse (gemessen am, Währung)	Sechsmonats-zeitraum
US-Large-Cap-Aktien (S&P 500 Index, USD)	16,89 %
Globale Aktien (MSCI World Index, USD)	15,09 %
Europäische Aktien (MSCI Europe Index, EUR)	11,12 %
Schwellenländeraktien (MSCI Emerging Markets Index, EUR)	4,89 %
Japanische Aktien (Nikkei 225 Index, JPY)	28,65 %
Lokale Anleihen von Schwellenländern (JPMorgan Government Bond Index-Emerging Markets Global Diversified Index, USD Unhedged)	7,79 %
Auslandsschulden von Schwellenländern (JPMorgan Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global, USD Hedged)	3,81 %
Anleihen mit einem Rating unter dem Investment Grade (ICE BofAML Developed Markets High Yield Constrained Index, USD Hedged)	5,45 %
Kreditanleihen mit Investment Grade (Bloomberg Global Aggregate Credit Index, USD Hedged)	3,00 %
Festverzinsliche Staatsanleihen in Lokalwährung der Investment-Grade-Länder (Bloomberg Global Treasury Index, USD Hedged)	3,13 %

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

Aussagen zu Finanzmarkttrends sind auf aktuellen Marktbedingungen begründet, die schwanken können. Es kann nicht garantiert werden, dass diese Anlagestrategien unter allen Marktbedingungen funktionieren oder für alle Anleger geeignet sind. Alle Anleger sollten insbesondere in Zeiten eines Marktabschwungs hinterfragen, ob sie auch langfristig anlegen können. Ausblick und Strategien können sich ohne Vorankündigung ändern.

Wichtige Angaben zu den Fonds

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

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

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

Einige Fonds können eine SGU-Anlagestrategie (Umwelt, Soziales und Unternehmensführung) verfolgen, gemäß derer Wertpapiere bestimmter Emittenten in der Regel aus anderen Gründen als der Wertentwicklung ausgewählt oder ausgeschlossen werden. Diese Strategie birgt das Risiko, dass sich die Wertentwicklung eines Fonds von ähnlichen Fonds, die keine SGU-Anlagestrategie verfolgen, unterscheidet. Diese Strategie könnte sich etwa auf das Engagement eines Fonds in bestimmten Bereichen oder Anlagearten auswirken und somit negative Folgen für die Wertentwicklung eines Fonds mit sich bringen. Es gibt keine Garantie dafür, dass die vom Anlageberater angewendeten Faktoren die Meinungen eines bestimmten Anlegers widerspiegeln; diese vom Anlageberater angewendeten Faktoren können von denjenigen abweichen, die ein bestimmter Anleger bei der Beurteilung der SGU-Praktiken eines Emittenten für relevant hält. Zukünftige SGU-Entwicklungen und -Regulierungen können die Umsetzung der Anlagestrategie eines Fonds beeinflussen. Darüber hinaus können sich Kosten aus SGU-bezogenen Due Diligence-Prüfungen, vermehrten Berichterstattung und der Inanspruchnahme externer SGU-Datenanbieter ergeben.

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

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

Bestimmte Wertpapiere und Instrumente, in die ein Fonds investieren kann, stützen sich gegebenenfalls in bestimmter Weise auf den London Interbank Offered Rate („LIBOR“). Der LIBOR ist ein durchschnittlicher Zinssatz, den die ICE Benchmark Administration bestimmt und den sich Banken gegenseitig für die Nutzung kurzfristiger Geldmittel berechnen. Angesichts der schrittweisen Einstellung der Nutzung des LIBOR müssen sich die entsprechenden Fonds auf einen anderen Vergleichsindex umstellen (z. B. des Secured Overnight Financing Rate (SOFR), der den USD-LIBOR ersetzen soll, und mit dem die Kosten von Übernachtkrediten in Form von mit US-Schatzpapieren besicherten Pensionsgeschäften gemessen wird). Die möglichen Auswirkungen des Übergangs weg vom LIBOR auf einen Fonds oder auf bestimmte Wertpapiere und Instrumente, in die ein Fonds investiert, lassen sich gegebenenfalls nur schwer ermitteln, und sie können abhängig von diesen Faktoren unterschiedlich ausfallen: Der Übergang kann außerdem zu einer Verringerung des Werts bestimmter von einem Fonds gehaltener Anlagen oder zu einer Verringerung der Wirksamkeit damit verbundener Fondstransaktionen wie z.B. Absicherungen führen. Derartige Folgen des Übergangs weg vom LIBOR sowie andere unvorhergesehene Auswirkungen könnten dazu führen, dass ein Fonds Verluste erleidet.

Die Überblicksseiten der einzelnen Fonds in diesem halbjährlichen Bericht bieten eine Tabelle zur Nettowertentwicklung, in der die Wertentwicklung – davon ausgehend, dass alle Dividenden und Kapitalgewinnausschüttungen wiederangelegt wurden – gemessen wird. In den Renditen nicht berücksichtigt ist der Abzug von Steuern, die ein Anteilinhaber zahlen würde auf: (i) Ausschüttungen des Fonds; oder (ii) die Rücknahme von Fondsanteilen. In der Tabelle zur Nettowertentwicklung wird die Wertentwicklung jedes Fonds mit der Wertentwicklung eines breit angelegten Wertpapiermarktindex (Vergleichsindex) verglichen. Die frühere Wertentwicklung jedes Fonds vor und nach Steuern ist nicht unbedingt ein Indikator dafür, wie sich der Fonds in der Zukunft entwickeln wird. Anlagen in einem Fonds gelten nicht als Bankeinlagen und werden nicht von einer behördlichen Stelle verbürgt oder versichert. Der Wert der und die Einkünfte aus den Anteilen am Fonds können steigen oder sinken; eventuell erhalten Sie nicht den ursprünglich in den Fonds investierten Betrag zurück.

Wichtige Angaben zu den Fonds (Forts.)

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

Definierte Begriffe, die in diesem Halbjahresbericht verwendet werden und nicht anderweitig definiert sind, haben die im Prospekt der Gesellschaft genannte Bedeutung.

Gesamtrendite, ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2023 abgelaufenen Berichtszeitraum[1]

	6 Monate	Auflegung von Klassen
Auf USD lautende Klassen		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 14. Feb. 2019)	(0,79 %)	(2,81 %)
Institutional, ausschüttend (Auflegung: 14. Feb. 2019)	(0,79 %)	(2,79 %)
Investor, thesaurierend (Auflegung: 25. Mai 2021)	(0,93 %)	(13,20 %)
Investor, ausschüttend (Auflegung: 20. Aug. 2020)	(0,91 %)	(7,98 %)
Administrative, ausschüttend (Auflegung: 14. Feb. 2019)	(1,03 %)	(3,27 %)
Class E, thesaurierend (Auflegung: 01. Jul. 2020)	(1,22 %)	(6,90 %)
Class E, ausschüttend (Auflegung: 14. Feb. 2019)	(1,23 %)	(3,66 %)
H Institutional, thesaurierend (Auflegung: 12. Mrz. 2021)	(0,91 %)	(11,14 %)
H Institutional, ausschüttend (Auflegung: 12. Mrz. 2021)	(1,01 %)	(11,15 %)
M Retail, ausschüttend II (Auflegung: 14. Feb. 2019)	(1,09 %)	(3,64 %)
Class Z, thesaurierend (Auflegung: 14. Feb. 2019)	(0,44 %)	(2,16 %)
JPMorgan JACI Non-Investment Grade Index	1,99 %	(3,02 %)[2]
Auf AUD lautende Klassen		
Institutional AUD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Jul. 2021)	(2,14 %)	(12,77 %)
Investor AUD (Hedged), ausschüttend (Auflegung 30. Sep. 2020)	(2,20 %)	(8,77 %)
JPMorgan JACI Non-Investment Grade Index (AUD Hedged)	0,76 %	(9,00 %)[2]
Auf CHF lautende Klassen		
Institutional CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung 23. Okt. 2020)	(2,96 %)	(9,94 %)
Institutional CHF (Hedged), ausschüttend (Auflegung 23. Okt. 2020)	(2,98 %)	(9,94 %)
Class E CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung 23. Okt. 2020)	(3,41 %)	(10,74 %)
Class E CHF (Hedged), ausschüttend (Auflegung 23. Okt. 2020)	(3,41 %)	(10,74 %)
JPMorgan JACI Non-Investment Grade Index (CHF Hedged)	(0,18 %)	(10,23 %)
Auf CNH lautende Klassen		
Investor RMB (Hedged), ausschüttend (Auflegung 09. Okt. 2020)	(2,49 %)	(7,64 %)
JPMorgan JACI Non-Investment Grade Index (CNH Hedged)	0,38 %	(7,61 %)
Auf EUR lautende Klassen		
Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 25. Sep. 2020)	(2,04 %)	(9,16 %)
Institutional EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung 25. Sep. 2020)	(2,06 %)	(9,13 %)
Investor EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung 10. Sep. 2020)	(2,35 %)	(9,93 %)
Class E EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 25. Sept. 2020)	(2,47 %)	(9,94 %)
Class E EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung 25. Sep. 2020)	(2,64 %)	(9,98 %)
JPMorgan JACI Non-Investment Grade Index (EUR Hedged)	0,61 %	(10,06 %)[2]
Auf GBP lautende Klassen		
Institutional GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 29. Jul. 2021)	(1,28 %)	(12,55 %)
Institutional GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 06. Mai 2021)	(1,36 %)	(12,88 %)
JPMorgan JACI Non-Investment Grade Index (GBP Hedged)	1,37 %	(13,11 %)[2]
Auf HKD lautende Klassen		
Class E HKD (Unhedged), ausschüttend (Auflegung: 14. Feb. 2019)	(0,81 %)	(3,66 %)
M Retail HKD (Unhedged), ausschüttend II (Auflegung: 14. Feb. 2019)	(0,96 %)	(3,71 %)
JPMorgan JACI Non-Investment Grade Index (HKD Unhedged)	2,40 %	(3,05 %)
Auf SGD lautende Klassen		
Institutional SGD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Jul. 2021)	(1,41 %)	(12,13 %)
Investor SGD (Hedged), ausschüttend (Auflegung 20. Aug. 2020)	(1,65 %)	(8,21 %)
Class E SGD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 14. Feb. 2019)	(1,86 %)	(4,02 %)
M Retail SGD (Hedged), ausschüttend II (Auflegung: 14. Feb. 2019)	(1,92 %)	(4,02 %)
JPMorgan JACI Non-Investment Grade Index (SGD Hedged)	1,27 %	(3,57 %)[2]

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

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

Anlageziel und Überblick über die Strategie

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

Kommentare zum Fonds

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

» Die Auswahl taktischer Unternehmensanleihen aus Nicht-Schwellenländern trug zur relativen Wertentwicklung bei.

» Die Untergewichtung der Positionierung in US-Duration trug ebenfalls zur relativen Wertentwicklung bei, da die Renditen während des Berichtszeitraums stiegen.

» Es gab ansonsten keine anderen Faktoren, die einen wesentlichen Beitrag leisteten.

» Die Titelauswahl im chinesischen Immobiliensektor war der relativen Wertentwicklung dagegen abträglich.

» Die Untergewichtung des Engagements in Staatsanleihen aus den Schwellenländern Asiens schmälerte die relative Wertentwicklung, insbesondere aufgrund der Untergewichtung von sri-lankischen Staatsanleihen.

» Die Untergewichtung der Allokation in Quasi-Staatsanleihen aus den Schwellenländern Asiens beeinträchtigte die relative Wertentwicklung.

Gesamtrendite, ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2023 abgelaufenen Berichtszeitraum[1]

	6 Monate	Auflegung von Klassen
Auf USD lautende Klassen		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 02. Mai 2023)	—	(0,50 %)
Institutional, ausschüttend (Auflegung 04. Sep. 2020)	1,34 %	(4,02 %)
Investor, thesaurierend (Auflegung: 02. Mai 2023)	—	(0,50 %)
Class E, thesaurierend (Auflegung 04. Sep. 2020)	0,81 %	(4,86 %)
Class E, ausschüttend (Auflegung: 01. Jun. 2010)	0,97 %	2,28 %
Class Z, thesaurierend (Auflegung 01. Dez. 2020)	1,59 %	(4,25 %)
JPMorgan Asia Credit Index[3]	2,92 %	3,10 %[2]
Auf EUR lautende Klassen		
Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 02. Mai 2023)	—	(0,90 %)
Institutional EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 05. Mrz. 2021)	0,13 %	(7,13 %)
Investor EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 02. Mai 2023)	—	(1,00 %)
E Class EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 05. Mrz. 2021)	(0,36 %)	(7,91 %)
JPMorgan Asia Credit Index (EUR Hedged)[3]	1,65 %	(6,14 %)[2]
Auf EUR lautende Klassen (nicht abgesichert)		
Class E EUR (Unhedged), thesaurierend (Auflegung 03. Jun. 2011)	(1,34 %)	2,81 %
JPMorgan Asia Credit Index (EUR Unhedged)[3]	0,68 %	4,13 %
Auf GBP lautende Klassen		
Institutional GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 13. Aug. 2021)	0,70 %	(7,82 %)
JPMorgan Asia Credit Index (GBP Hedged)[3]	2,38 %	(6,55 %)
Auf HKD lautende Klassen		
Class E HKD (Unhedged), ausschüttend (Auflegung 04. Sep. 2020)	1,26 %	(4,47 %)
M Retail HKD (Unhedged), ausschüttend (Auflegung: 01. Mrz. 2011)	1,25 %	0,91 %
JPMorgan Asia Credit Index (HKD Unhedged)[3]	3,41 %	2,03 %[2]
Auf SGD lautende Klassen		
Institutional SGD (Hedged), ausschüttend (Auflegung 09. Okt. 2020)	0,61 %	(4,12 %)
Class E SGD (Hedged), ausschüttend (Auflegung 09. Okt. 2020)	0,26 %	(4,91 %)
JPMorgan Asia Credit Index (SGD Hedged)[3]	2,29 %	(3,82 %)

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

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

3 *Die Wertentwicklung des Vergleichsindex für den Asia Strategic Interest Bond Fund repräsentiert Folgendes: Auflegung bis 31. Mai 2016: [90 % JPMorgan Asia Credit Index (JACI) + 10 % 1-Monats-USD-Libor] * [JPMorgan Emerging Local Markets Index (ELMI+)] / [3-Monats-USD-Libor]; ab 01. Juni 2016: JPMorgan Asia Credit Index*

Anlageziel und Überblick über die Strategie

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

Kommentare zum Fonds

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

» Das Engagement in Unternehmensanleihen aus Asien ohne China/Hongkong trug zur absoluten Wertentwicklung bei.

» Das Engagement in Staatsanleihen von Pakistan und Sri Lanka förderte ebenfalls die absolute Wertentwicklung.

» Auch das Engagement in asiatische Quasi-Staatsanleihen trug zur absoluten Wertentwicklung bei.

» Das Engagement in Unternehmensanleihen aus China/Hongkong schmälerte jedoch die absolute Wertentwicklung, insbesondere aufgrund eines Engagements in chinesischen Immobilien.

» Das Engagement in US-Duration schmälerte die absolute Wertentwicklung, da die Zinsen während des Berichtszeitraums stiegen.

Gesamtrendite, ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2023 abgelaufenen Berichtszeitraum[1]

	6 Monate	Auflegung von Klassen
Auf USD lautende Klassen		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 31. Jul. 2013)	(1,18 %)	4,35 %
Institutional, ausschüttend (Auflegung: 23. Sep. 2014)	(1,16 %)	3,42 %
Investor, thesaurierend (Auflegung: 19. Mai 2014)	(1,35 %)	3,02 %
Investor, ausschüttend (Auflegung: 19. Mai 2014)	(1,36 %)	3,03 %
Administrative, thesaurierend (Auflegung: 09. Aug. 2013)	(1,40 %)	3,76 %
Administrative, ausschüttend (Auflegung: 09. Aug. 2013)	(1,45 %)	3,75 %
Administrative, ausschüttend II (Auflegung: 12. Aug. 2022)	(1,40 %)	(3,34 %)
Class E, thesaurierend (Auflegung: 28. Okt. 2013)	(1,61 %)	3,11 %
Class E, ausschüttend (Auflegung: 19. Mai 2014)	(1,62 %)	2,48 %
M Retail, ausschüttend II (Auflegung: 23. Dez. 2013)	(1,63 %)	2,88 %
Class R, ausschüttend (Auflegung: 18. Mrz. 2014)	(1,31 %)	3,37 %
Class T, ausschüttend (Auflegung: 16. Okt. 2014)	(1,82 %)	2,39 %
Class Z, ausschüttend (Auflegung: 31. Okt. 2013)	(0,80 %)	4,82 %
ICE BofA SOFR Overnight Rate Index[3]	2,40 %	1,26 %[2]
Auf AUD lautende Klassen		
Investor AUD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 23. Mai 2018)	(2,11 %)	0,64 %
Class Z AUD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 11. Aug. 2015)	(1,51 %)	3,60 %
Bloomberg AusBond Bank Bills Index	1,70 %	1,45 %[2]
Auf BRL lautende Klassen		
Institutional BRL (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 02. Jan. 2018)	11,84 %	(1,39 %)
ICE BofA SOFR Overnight Rate Index (BRL Hedged)[3]	15,87 %	(0,85 %)
Auf CAD lautende Klassen		
Investor CAD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 25. Jun. 2018)	(1,57 %)	1,40 %
Canadian Overnight Repo Rate (CORRA)[4]	2,25 %	1,51 %
Auf CHF lautende Klassen		
Institutional CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 09. Aug. 2013)	(3,18 %)	2,14 %
Class E CHF (Hedged), thesaurierende Anteile (Auflegung: 18. Jun. 2014)	(3,56 %)	0,03 %
ICE BofA SARON Overnight Rate Index[5]	0,61 %	(0,69 %)[2]
Auf EUR lautende Klassen		
Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 09. Aug. 2013)	(2,28 %)	2,60 %
Institutional EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 09. Aug. 2013)	(2,27 %)	2,61 %
Institutional EUR (Hedged), ausschüttend II (Auflegung: 29. Jul. 2014)	(2,24 %)	1,51 %
Investor EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 26. Feb. 2016)	(2,37 %)	1,96 %
Administrative EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 09. Aug. 2013)	(2,51 %)	2,08 %
Class E EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 28. Okt. 2013)	(2,72 %)	1,42 %
Class E EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Okt. 2015)	(2,68 %)	0,35 %
Class R EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 18. Jun. 2014)	(2,31 %)	1,27 %
Class T EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 30. Sep. 2014)	(2,91 %)	0,39 %
Euro Short-Term Rate (ESTER) Index[6]	1,34 %	(0,06 %)[2]
Auf GBP lautende Klassen		
Institutional GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 09. Aug. 2013)	(1,49 %)	3,38 %
Institutional GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 31. Jul. 2013)	(1,44 %)	3,45 %
Investor GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 29. Jan. 2020)	(1,64 %)	(2,46 %)
Class R GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 18. Jun. 2014)	(1,59 %)	2,06 %
ICE BofA SONIA Overnight Rate Index[7]	2,06 %	0,77 %[2]
Auf HKD lautende Klassen		
M Retail HKD (Unhedged), ausschüttend (Auflegung: 28. Jul. 2017)	(1,19 %)	1,28 %
3 Month HIBOR Index	2,20 %	1,63 %

Anlageziel und Überblick über die Strategie

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

Kommentare zum Fonds

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

» Das Engagement in und die Titelauswahl vorrangiger Finanztitel trugen zur Wertentwicklung bei, da die Spreads schrumpften.

» Die Titelauswahl bei Tier-2-Anleihen trug zur Wertentwicklung bei, da eine ausgewählte britische Bank ankündigte, dass sie ihre Legacy Tier-2-Anleihen zum nächsten Kündigungstermin zurücknehmen würde.

» Das Engagement in AT1, die von einer Schweizer Bank begeben wurden, war der Wertentwicklung abträglich, da sie nach der Übernahme durch einen lokalen Wettbewerber abgeschrieben wurden.

» Das Engagement in AT1 und insbesondere in britischen Banken schmälerte die Wertentwicklung, da der globale Bankenmarkt aufgrund einer Vertrauenskrise unter Druck geriet, die von kleineren regionalen US-Banken herrührte und sich bis nach Europa ausbreitete.

» Das Engagement in einem ausgewählten nachrangigen Hybridemittenten außerhalb des Sektors Finanzen beeinträchtigte die Wertentwicklung.

Gesamtrendite nach Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2023 abgelaufenen Berichtszeitraum[1] (Forts.)

	6 Monate	Auflegung von Klassen
Auf SGD lautende Klassen		
Institutional SGD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Jul. 2021)	(1,69 %)	(6,89 %)
Investor SGD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 23. Mai 2018)	(1,89 %)	1,22 %
Administrative SGD (Hedged), ausschüttend II (Auflegung: 12. Aug. 2022)	(1,92 %)	(3,98 %)
M Retail SGD (Hedged) ausschüttend II (Auflegung 23. Dez. 2013)	(2,06 %)	2,66 %
SORA Singapore Interbank Overnight Rate Average[8]	1,82 %	1,22 %[2]

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

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

3 *Die Wertentwicklung des Vergleichsindex für den PIMCO Capital Securities Fund repräsentiert Folgendes: Auflegung bis 30. Juni 2022: 3 Month USD LIBOR; ab 01. Juli 2022: ICE BofA SOFR Overnight Rate Index*

4 *Die Wertentwicklung des Vergleichsindex für den PIMCO Capital Securities Fund repräsentiert Folgendes: Auflegung bis zum 30. Juni 2022: 3 Month USD LIBOR (CAD Hedged) Index; ab 01. Juli 2022: Canadian Overnight Repo Rate (CORRA)*

5 *Die Wertentwicklung des Vergleichsindex für den PIMCO Capital Securities Fund repräsentiert Folgendes: Auflegung bis 30. Juni 2021: 3 Month USD LIBOR (Hedged to CHF) Index; ab 01. Juli 2021: ICE BofA SARON Overnight Rate Index*

6 *Die Wertentwicklung des Vergleichsindex für den PIMCO Capital Securities Fund repräsentiert Folgendes: Auflegung bis 30. Juni 2021: 3 Month Euribor Index; ab 01. Juli 2021: Euro Short-Term Rate (ESTER) Index*

7 *Die Wertentwicklung des Vergleichsindex für den PIMCO Capital Securities Fund repräsentiert Folgendes: Auflegung bis 30. Juni 2021: 3 Month GBP LIBOR Index; ab 01. Juli 2021: ICE BofA SONIA Overnight Rate Index*

8 *Die Wertentwicklung des Vergleichsindex für den PIMCO Capital Securities Fund repräsentiert Folgendes: Auflegung bis 30. Juni 2022: 3 Month GBP LIBOR Index; ab 01. Juli 2022: SORA Singapore Interbank Overnight Rate Average*

Gesamtrendite, ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2023 abgelaufenen Berichtszeitraum[1]

	6 Monate	Auflegung von Klassen
Auf USD lautende Klassen		
Institutional, thesaurierend (Auflegung 23. Sep. 2020)	2,27 %	(3,66 %)
Investor, thesaurierend (Auflegung: 28. Feb. 2023)	—	1,10 %
Class Z, thesaurierend (Auflegung 23. Sep. 2020)	2,46 %	(3,16 %)
Bloomberg MSCI Green Bond Index (USD Hedged)	3,28 %	(5,71 %)[2]
Auf AUD lautende Klassen		
Institutional AUD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 17. Apr. 2023)	—	(0,52 %)
Bloomberg MSCI Green Bond Index (AUD Hedged)	2,35 %	0,59 %
Auf CHF lautende Klassen		
Institutional CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung 13. Nov. 2020)	0,12 %	(6,29 %)
Bloomberg MSCI Green Bond Index (CHF Hedged)	1,06 %	(8,52 %)
Auf EUR lautende Klassen		
Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 23. Sep. 2020)	1,05 %	(5,19 %)
Institutional EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 02. Dez. 2020)	1,10 %	(5,89 %)
Class E EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 23. Sept. 2020)	0,60 %	(6,03 %)
Bloomberg MSCI Green Bond Index (EUR Hedged)	1,97 %	(7,32 %)[2]
Auf GBP lautende Klassen		
Institutional GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 23. Sep. 2020)	1,72 %	(4,24 %)
Institutional GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Apr. 2021)	1,72 %	(5,58 %)
Bloomberg MSCI Green Bond Index (GBP Hedged)	2,73 %	(6,42 %)[2]
Auf SEK lautende Klassen		
Institutional SEK (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 30. Jun. 2021)	1,11 %	(7,18 %)
Administrative SEK (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 08. Okt. 2021)	0,85 %	(8,65 %)
Bloomberg MSCI Green Bond Index (SEK Hedged)	2,22 %	(9,11 %)[2]
Auf SGD lautende Klassen		
Institutional SGD (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 26. Feb. 2021)	1,59 %	(4,77 %)
Bloomberg MSCI Green Bond Index (SGD Hedged)	2,61 %	(6,73 %)

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

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

Anlageziel und Überblick über die Strategie

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

Kommentare zum Fonds

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

» Die schrumpfenden Spreads und der Carry in Unternehmensanleihen mit Investment Grade, insbesondere im Finanzsektor, trugen zur absoluten Wertentwicklung bei.

» Die schrumpfenden Spreads und Titelauswahl bei Schuldtiteln aus Schwellenländern, insbesondere im Versorgungssektor, trugen zur absoluten Wertentwicklung bei.

» Das Long-Engagement in Spreadrisiken hochverzinslicher Unternehmensanleihen, insbesondere im Sektor Automobil, war der absoluten Wertentwicklung zuträglich, da die Spreads schrumpften.

» Das moderate Long-Engagement in US-Duration schmälerte die absolute Wertentwicklung, da die Renditen zurückgingen.

» Das moderate Long-Engagement im vorderen und mittleren Bereich der britischen und europäischen Renditekurven belastete die absolute Wertentwicklung, da die Renditen stiegen.

Gesamtrendite, ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2023 abgelaufenen Berichtszeitraum[1]

	6 Monate	Auflegung von Klassen
Auf USD lautende Klassen		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 31. Aug. 2006)	(8,91 %)	(0,76 %)
Investor, thesaurierend (Auflegung: 11. Aug. 2011)	(9,01 %)	(2,31 %)
Class E, thesaurierend (Auflegung: 21. Sep. 2007)	(9,33 %)	(2,09 %)
H Institutional, thesaurierend (Auflegung: 29. Apr. 2022)	(8,98 %)	(20,02 %)
Bloomberg Commodity Index Total Return	(7,79 %)	(1,97 %)[2]
Auf EUR lautende Klassen		
Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 08. Jun. 2010)	(10,22 %)	(1,30 %)
Class E EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 07. Mrz. 2012)	(10,71 %)	(3,84 %)
Bloomberg Commodity Index Total Return (EUR Hedged)	(9,19 %)	(2,37 %)[2]
Auf EUR lautende Klassen (nicht abgesichert)		
Institutional EUR (Unhedged), thesaurierend (Auflegung: 11. Jun. 2021)	(10,94 %)	8,80 %
Bloomberg Commodity Index Total Return (EUR Unhedged)	(9,86 %)	11,08 %
Auf GBP lautende Klassen		
Institutional GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 01. Mrz. 2017)	(9,42 %)	2,83 %
Bloomberg Commodity Index Total Return (GBP Hedged)	(8,38 %)	2,34 %
Auf GBP lautende Klassen (nicht abgesichert)		
Institutional GBP (Unhedged), ausschüttend (Auflegung: 11. Nov. 2022)	(13,82 %)	(18,14 %)
Bloomberg Commodity Index Total Return (GBP Unhedged)	(12,77 %)	(17,10 %)
Auf SGD lautende Klassen		
E Class SGD (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 17. Dez. 2021)	(9,90 %)	1,23 %
Bloomberg Commodity Index Total Return (SGD Hedged)	(8,47 %)	5,60 %

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

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

Anlageziel und Überblick über die Strategie

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

Kommentare zum Fonds

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

» Die Kurvenpositionierung in der britischen Breakeven-Inflationsrate, insbesondere eine Übergewichtung des 5-jährigen Bereichs der Kurve, trug zur Wertentwicklung bei, da die 5-jährigen britischen Breakeven-Inflationsraten stiegen.

» Aktive Rohstoffstrategien, insbesondere eine Untergewichtung des Engagements im Teilsektor Erdgas, trugen zur relativen Wertentwicklung bei, da der vom Bloomberg Natural Gas Subindex gemessene Teilsektor schlechter abschnitt als der breiter aufgestellte Bloomberg Commodity Index.

» Das Engagement in hypothekenbesicherten Wertpapieren ohne Agency-Schuldtitel trugen zur relativen Wertentwicklung bei, da die Spreads auf diese Wertpapiere schrumpften.

» Die strukturelle Allokation auf globale kurzfristige inflationsgebundene Anleihen (ILB) als Sicherheiten zur Deckung des Rohstoffengagements des Fonds schmälerte die relative Wertentwicklung, da sich globale kurzfristige TIPS gemessen am Bloomberg Barclays World Government Inflation-Linked Bond 1-5 Year Index (USD Hedged) schwächer entwickelten als die am ICE BofAML U.S. 3-Month Treasury Bill Index gemessenen 3-Monats-US-Schatzpapieren.

» Die Untergewichtung des Engagements in nominalen japanischen Staatszinsen belastete die relative Wertentwicklung, da die nominalen Renditen in Japan zurückgingen.

» Die Übergewichtung des Engagements in dänischen gedeckten Schuldverschreibungen war der relativen Wertentwicklung abträglich, da sich diese Wertpapiere unterdurchschnittlich entwickelten.

Gesamtrendite, ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2023 abgelaufenen Berichtszeitraum[1]

	6 Monate	Auflegung von Klassen
Auf USD lautende Klassen		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 14. Okt. 2011)	3,32 %	2,93 %
Class E, thesaurierend (Auflegung: 21. Dez. 2012)	2,86 %	1,35 %
ICE BofA SOFR Overnight Rate Index[3]	2,40 %	1,13 %[2]
Auf CHF lautende Klassen		
Institutional CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 17. Dez. 2012)	1,17 %	0,35 %
ICE BofA SARON Overnight Rate Index[4]	0,61 %	(0,66 %)
Auf EUR lautende Klassen		
Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 14. Okt. 2011)	2,04 %	1,58 %
Class E EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 21. Dez. 2012)	1,64 %	(0,09 %)
Euro Short-Term Rate (ESTER) Index[5]	1,34 %	0,05 %[2]

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

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

3 *Die Wertentwicklung des Vergleichsindex für den PIMCO Credit Opportunities Bond Fund repräsentiert Folgendes: Auflegung bis 30. Juni 2022: 3 Month USD LIBOR Index; ab 01. Juli 2022: ICE BofA SOFR Overnight Rate Index*

4 *Die Wertentwicklung des Vergleichsindex für den PIMCO Credit Opportunities Bond Fund repräsentiert Folgendes: Auflegung bis 30. Juni 2021: 3 Month USD LIBOR (Hedged to CHF) Index; ab 01. Juli 2021: ICE BofA SARON Overnight Rate Index*

5 *Die Wertentwicklung des Vergleichsindex für den PIMCO Credit Opportunities Bond Fund repräsentiert Folgendes: Auflegung bis 30. Juni 2021: 3 Month Euribor Index; ab 01. Juli 2021: Euro Short-Term Rate (ESTER) Index*

Anlageziel und Überblick über die Strategie

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

Kommentare zum Fonds

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

» Das Long-Engagement in Schuldtiteln mit Investment Grade begünstigte die Wertentwicklung, insbesondere das Engagement in Emittenten aus den Sektoren Banken, Immobilieninvestmentgesellschaften und Technologie, da sich die Spreads auf diese Wertpapiere verschmälerten.

» Das Long-Engagement in Hochzinsanleihen begünstigte die Wertentwicklung, insbesondere das Engagement in Emittenten aus den Sektoren Bau und Unterhaltung, da sich die Spreads auf diese Wertpapiere verschmälerten.

» Das Long-Engagement in ausgewählten lateinamerikanischen Währungen trug zur Wertentwicklung bei, da die Währungen gegenüber dem US-Dollar an Wert zulegten.

» Das Long-Engagement in US-Duration schmälerte die Wertentwicklung, da die US-Renditen anstiegen.

» Das Long-Engagement in ausgewählten verbrieften Vermögenswerten belastete die Wertentwicklung, da sich die Spreads auf diese Wertpapiere ausweiteten.

Gesamtrendite, ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2023 abgelaufenen Berichtszeitraum[1]

	6 Monate	Auflegung von Klassen
Auf USD lautende Klassen		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 30. Jun. 2005)	3,10 %	5,04 %
Institutional, ausschüttend (Auflegung: 08. Sep. 2008)	3,05 %	5,02 %
Investor, thesaurierend (Auflegung: 30. Apr. 2013)	2,94 %	2,03 %
Investor, ausschüttend (Auflegung: 30. Apr. 2013)	2,94 %	2,03 %
Administrative, ausschüttend (Auflegung: 21. Jul. 2011)	2,82 %	3,02 %
BM Retail, ausschüttend II (Auflegung: 28. Apr. 2022)	2,19 %	(3,51 %)
BN Retail, ausschüttend II (Auflegung: 28. Aug. 2022)	2,08 %	(3,59 %)
Class E, thesaurierend (Auflegung: 11. Sep. 2006)	2,62 %	4,04 %
Class E, ausschüttend (Auflegung: 31. Jul. 2006)	2,57 %	4,12 %
H Institutional, thesaurierend (Auflegung: 08. Jun. 2011)	3,04 %	3,35 %
H Institutional, ausschüttend (Auflegung: 14. Mai 2020)	3,03 %	(1,16 %)
M Retail, ausschüttend (Auflegung: 30. Nov. 2010)	2,60 %	2,88 %
M Retail, ausschüttend II (Auflegung: 23. Dez. 2013)	2,64 %	2,00 %
N Retail, ausschüttend II (Auflegung 30. Okt. 2020)	2,67 %	(4,56 %)
Class T, thesaurierend (Auflegung: 16. Okt. 2014)	2,47 %	1,31 %
Class T, ausschüttend (Auflegung: 16. Okt. 2014)	2,43 %	1,31 %
Class W, thesaurierend (Auflegung 12. Aug. 2020)	3,21 %	(3,59 %)
Class W, ausschüttend (Auflegung 12. Aug. 2020)	3,11 %	(3,63 %)
Jeweils 1/3: Bloomberg Global Aggregate Credit ex Emerging Markets (USD Hedged), ICE BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index (USD Hedged) und JPMorgan EMBI Global (USD Hedged)[3]	3,96 %	4,90 %[2]
Auf AUD lautende Klassen		
M Retail AUD (Hedged) ausschüttend (Auflegung 19. Dez. 2012)	1,76 %	1,98 %
Jeweils 1/3: Bloomberg Global Aggregate Credit ex Emerging Markets (AUD Hedged), ICE BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index (AUD Hedged) und JPMorgan EMBI Global (AUD Hedged)[3]	2,98 %	3,01 %
Auf CAD lautende Klassen		
Institutional CAD (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 20. Feb. 2019)	2,77 %	0,05 %
Jeweils 1/3: Bloomberg Global Aggregate Credit ex Emerging Markets (CAD Hedged), ICE BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index (CAD Hedged) und JPMorgan EMBI Global (CAD Hedged)[3]	3,58 %	0,61 %
Auf CHF lautende Klassen		
Institutional CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 24. Jun. 2011)	0,91 %	1,63 %
Institutional CHF (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 31. Aug. 2012)	0,83 %	0,87 %
Class E CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 11. Sept. 2019)	0,48 %	(4,57 %)
Class W CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung 12. Aug. 2020)	0,96 %	(5,79 %)
Class W CHF (Hedged), ausschüttend (Auflegung 12. Aug. 2020)	0,99 %	(5,75 %)
Jeweils 1/3: Bloomberg Global Aggregate Credit ex Emerging Markets (CHF Hedged), ICE BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index (CHF Hedged) und JPMorgan EMBI Global (CHF Hedged)[3]	1,71 %	1,80 %[2]
Auf EUR lautende Klassen		
Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 14. Feb. 2007)	1,83 %	3,75 %
Institutional EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 17. Okt. 2007)	1,85 %	3,75 %
Investor EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 05. Jul. 2007)	1,66 %	3,53 %
Investor EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 15. Feb. 2013)	1,65 %	0,62 %
Administrative EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 20. Jul. 2007)	1,55 %	3,37 %
Class E EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 03. Jul. 2007)	1,34 %	2,99 %
Class E EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 16. Okt. 2009)	1,35 %	2,36 %
Class T EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 30. Sep. 2014)	1,17 %	(0,60 %)
Class T EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Sep. 2014)	1,06 %	(0,61 %)

Anlageziel und Überblick über die Strategie

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

Kommentare zum Fonds

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

» Die Titelauswahl bei Schuldtiteln mit Investment Grade trug zur Wertentwicklung bei, einschließlich des Engagements in ausgewählten Emittenten aus den Sektoren Bank und Transport, die überdurchschnittlich abschnitten.

» Das taktische Engagement im Credit Derivative Index (CDX) begünstigte die Wertentwicklung, da es sich besser entwickelte als Baranleihen.

» Die Titelauswahl bei Hochzinsanleihen war der Wertentwicklung abträglich, darunter die Übergewichtung einer ausgewählten europäischen Bank, die aufgrund einer Vertrauenskrise eine Underperformance aufwies, und die Übergewichtung eines Engagements in ausgewählten Emittenten im Sektor Medien, die eine Underperformance aufwiesen.

» Die Titelauswahl in Schwellenländern, einschließlich des Engagements in ausgewählten chinesischen Immobilienentwicklern und in Schuldtiteln ausgewählter lateinamerikanischer Emittenten im Sektor Energie, da diese in den Erwartungen zurückblieben.

» Das taktische Engagement in verbrieften Krediten schmälerte die Wertentwicklung, einschließlich des Engagements in hypothekenbesicherten Wertpapieren mit Agency-Schuldtiteln und ausgewählten hypothekenbesicherten Wertpapieren ohne Agency-Schuldtitel, da sich die Spreads auf diese Wertpapiere ausweiteten.

Gesamtrendite nach Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2023 abgelaufenen Berichtszeitraum[1] (Forts.)	6 Monate	Auflegung von Klassen
Class W EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung 12. Aug. 2020)	1,90 %	(5,25 %)
Class W EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung 12. Aug. 2020)	1,92 %	(5,27 %)
Jeweils 1/3: Bloomberg Global Aggregate Credit ex Emerging Markets (EUR Hedged), ICE BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index (EUR Hedged) und JPMorgan EMBI Global (EUR Hedged)[3]	2,61 %	3,41 %[2]
Auf GBP lautende Klassen		
Institutional GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 16. Mai 2006)	2,60 %	4,70 %
Institutional GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 14. Feb. 2006)	2,53 %	4,64 %
Administrative GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 21. Jul. 2011)	2,39 %	2,33 %
Class W GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung 12. Aug. 2020)	2,68 %	(4,30 %)
Class W GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung 12. Aug. 2020)	2,68 %	(4,27 %)
Jeweils 1/3: Bloomberg Global Aggregate Credit ex Emerging Markets (GBP Hedged), ICE BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index (GBP Hedged) und JPMorgan EMBI Global (GBP Hedged)[3]	3,37 %	4,37 %[2]
Auf JPY lautende Klassen		
Administrative JPY (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 08. Okt. 2021)	0,12 %	(11,43 %)
Jeweils 1/3: Bloomberg Global Aggregate Credit ex Emerging Markets (JPY Hedged), ICE BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index (JPY Hedged) und JPMorgan EMBI Global (JPY Hedged)[3]	1,08 %	(8,91 %)
Auf MXN lautende Klassen		
Institutional MXN (Hedged), thesaurierend (Auflegung 09. Dez. 2020)	6,82 %	0,30 %
Jeweils 1/3: Bloomberg Global Aggregate Credit ex Emerging Markets (MXN Hedged), ICE BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index (MXN Hedged) und JPMorgan EMBI Global (MXN Hedged)[3]	7,69 %	2,30 %
Auf SEK lautende Klassen		
Institutional SEK (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 31. Mrz. 2006)	1,96 %	4,12 %
Administrative SEK (Hedged), thesaurierend (Auflegung 30. Dez. 2020)	1,70 %	(7,60 %)
Jeweils 1/3: Bloomberg Global Aggregate Credit ex Emerging Markets (SEK Hedged), ICE BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index (SEK Hedged) und JPMorgan EMBI Global (SEK Hedged)[3]	2,86 %	3,78 %[2]
Auf SGD lautende Klassen		
Institutional SGD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 07. Nov. 2019)	2,41 %	(1,99 %)
Administrative SGD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 01. Mai 2019)	2,18 %	(1,11 %)
E Class SGD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 01. Okt. 2019)	2,08 %	(2,81 %)
Class W SGD (Hedged), ausschüttend (Auflegung 12. Aug. 2020)	2,48 %	(3,87 %)
Jeweils 1/3: Bloomberg Global Aggregate Credit ex Emerging Markets (SGD Hedged), ICE BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index (SGD Hedged) und JPMorgan EMBI Global (SGD Hedged)[3]	3,30 %	0,18 %[2]

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

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

3 *Die Wertentwicklung des Vergleichsindex für den Diversified Income Fund repräsentiert Folgendes: Auflegung bis 09. November 2015: jeweils 1/3 Bloomberg Global Aggregate Credit Component (USD Hedged), ICE BofA Merrill Lynch Global High Yield BB-B Rated Constrained (USD Hedged) und JPMorgan EMBI Global; ab 10. November 2015: jeweils 1/3 Bloomberg Global Aggregate Credit ex Emerging Markets (USD Hedged), ICE BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index (USD Hedged) und JPMorgan EMBI Global (USD Hedged)*

Gesamtrendite, ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2023 abgelaufenen Berichtszeitraum[1]

	6 Monate	Auflegung von Klassen
Auf USD lautende Klassen		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 31. Mai 2011)	3,82 %	3,37 %
Investor, thesaurierend (Auflegung: 18. Feb. 2014)	3,67 %	2,34 %
Class E, thesaurierend (Auflegung: 16. Aug. 2013)	3,42 %	1,95 %
Class E, ausschüttend (Auflegung: 31. Mai 2011)	3,38 %	2,48 %
Jeweils 1/3: Bloomberg Global Aggregate Credit ex Emerging Markets (USD Hedged), ICE BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index (USD Hedged) und JPMorgan EMBI Global (USD Hedged)[3]	5,02 %	3,26 %[2]
Auf EUR lautende Klassen		
Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 16. Aug. 2011)	2,68 %	2,27 %
Institutional EUR (Hedged), ausschüttend II (Auflegung: 01. Okt. 2013)	2,69 %	1,23 %
Class E EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 11. Aug. 2011)	2,24 %	1,47 %
Class E EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung 07. Mai 2013)	2,19 %	0,06 %
Jeweils 1/3: Bloomberg Global Aggregate Credit ex Emerging Markets (EUR Hedged), ICE BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index (EUR Hedged) und JPMorgan EMBI Global (EUR Hedged)[3]	3,81 %	2,32 %[2]
Auf GBP lautende Klassen		
Institutional GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 23. Aug. 2011)	3,52 %	3,14 %
Institutional GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 22. Jan. 2013)	3,49 %	1,91 %
Jeweils 1/3: Bloomberg Global Aggregate Credit ex Emerging Markets (GBP Hedged), ICE BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index (GBP Hedged) und JPMorgan EMBI Global (GBP Hedged)[3]	4,51 %	3,06 %[2]

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

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

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

Anlageziel und Überblick über die Strategie

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

Kommentare zum Fonds

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

» Die Titelauswahl bei Schuldtiteln mit Investment Grade trug zur Wertentwicklung bei, einschließlich der Übergewichtung des Engagements in einen ausgewählten Emittenten im Sektor Technologie, der überdurchschnittlich abschnitt, und der Untergewichtung des Engagements in einem ausgewählten Emittenten im Sektor Dienstleistungen, der unterdurchschnittlich abschnitt.

» Das taktische Engagement im Credit Derivative Index (CDX) begünstigte die Wertentwicklung, da es sich besser entwickelte als Baranleihen.

» Die Titelauswahl in Schwellenländern war der Wertentwicklung abträglich, einschließlich des Engagements in ausgewählten chinesischen Immobilienentwicklern, da diese in den Erwartungen zurückblieben.

» Die Titelauswahl bei Hochzinsanleihen war der Wertentwicklung abträglich, einschließlich der Übergewichtung des Engagements in einen ausgewählten Emittenten im Sektor Telekommunikation, der eine Underperformance aufwies.

» Das taktische Engagement in verbrieften Krediten schmälerte die Wertentwicklung, einschließlich des Engagements in hypothekenbesicherten Wertpapieren mit Agency-Schuldtiteln und ausgewählten hypothekenbesicherten Wertpapieren ohne Agency-Schuldtitel, da sich die Spreads auf diese Wertpapiere ausweiteten.

Gesamtrendite, ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2023 abgelaufenen Berichtszeitraum[1]

	6 Monate	Auflegung von Klassen
Auf USD lautende Klassen		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 27. Jul. 2022)	3,34 %	2,20 %
E Class, thesaurierend (Auflegung: 27. Jul. 2022)	2,94 %	1,40 %
Jeweils 1/3: Bloomberg Barclays Global Aggregate Credit ex-Emerging Markets, ICE BofAML BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained ESG Tilt Index und JPMorgan ESG Emerging Markets Bond Index Global Diversified	3,86 %	2,74 %
Auf EUR lautende Klassen		
Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 27. Jul. 2022)	2,15 %	(0,30 %)
E Class EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 27. Jul. 2022)	1,65 %	(1,20 %)
Jeweils 1/3: Bloomberg Barclays Global Aggregate Credit ex-Emerging Markets (EUR Hedged), ICE BofAML BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained ESG Tilt Index (EUR Hedged) und JPMorgan ESG Emerging Markets Bond Index Global Diversified (EUR Hedged)	2,51 %	(0,06 %)
Auf GBP lautende Klassen		
Institutional GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 27. Jul. 2022)	2,85 %	1,10 %
Jeweils 1/3: Bloomberg Barclays Global Aggregate Credit ex-Emerging Markets (GBP Hedged), ICE BofAML BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained ESG Tilt Index (GBP Hedged) und JPMorgan ESG Emerging Markets Bond Index Global Diversified (GBP Hedged)	3,27 %	1,20 %

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

Anlageziel und Überblick über die Strategie

Das Anlageziel des Diversified Income ESG Fund ist es, die Erträge mit umsichtiger Anlageverwaltung zu maximieren. Der Fonds investiert mindestens zwei Drittel des Vermögens in ein diversifiziertes Portfolio aus festverzinslichen Anlagen mit unterschiedlichen Laufzeiten. Der Fonds ist bestrebt, unter normalen Marktbedingungen ökologische und soziale Merkmale zu bewerben (wie in der Ergänzung für den Fonds dargelegt) und einen Teil des Vermögens in nachhaltige Anlagen zu investieren.

Kommentare zum Fonds

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

» Eine Übergewichtung von Schuldtiteln mit Investment Grade trug insbesondere in den ersten vier Monaten des Jahres zur Wertentwicklung bei, da sie sich im Vergleich zu Hochzins- und Schwellenmarktanleihen überdurchschnittlich entwickelte.

» Es gab ansonsten keine anderen Faktoren, die einen wesentlichen Beitrag zu diesem Fonds leisteten.

» Die Titelauswahl in Schwellenländern war der Wertentwicklung abträglich, einschließlich des Engagements in Schuldtiteln eines ausgewählten lateinamerikanischen Emittenten im Sektor Kosmetik, der in den Erwartungen zurückblieb.

» Die Titelauswahl bei Hochzinsanleihen war der Wertentwicklung abträglich, einschließlich der Übergewichtung des Engagements in einen ausgewählten Emittenten im Sektor Gesundheitswesen, der eine Underperformance aufwies.

» Das taktische Engagement in verbrieften Krediten schmälerte die Wertentwicklung, insbesondere in hypothekenbesicherten Wertpapieren ohne Agency-Schuldtitel, da sich die Spreads ausweiteten.

Gesamtrendite, ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2023 abgelaufenen Berichtszeitraum[1]

	6 Monate	Auflegung von Klassen
Auf USD lautende Klassen		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 15. Dez. 2008)	2,43 %	2,29 %
Institutional, ausschüttend (Auflegung: 22. Feb. 2010)	2,44 %	1,94 %
Investor, thesaurierend (Auflegung: 24. Sep. 2010)	2,27 %	1,26 %
Investor, ausschüttend (Auflegung: 24. Sep. 2010)	2,31 %	1,25 %
Administrative, thesaurierend (Auflegung: 21. Jan. 2010)	2,20 %	1,42 %
Class E, thesaurierend (Auflegung: 11. Mai 2010)	2,09 %	0,89 %
Class E, ausschüttend (Auflegung: 11. Mai 2010)	2,04 %	0,90 %
H Institutional, thesaurierend (Auflegung: 12. Dez. 2018)	2,46 %	0,91 %
H Institutional, ausschüttend (Auflegung: 14. Feb. 2020)	2,41 %	(0,34 %)
Class R, thesaurierend (Auflegung: 30. Nov. 2012)	2,44 %	1,20 %
Class R, thesaurierend (Auflegung: 15. Sep. 2021)	2,93 %	(2,88 %)
ICE BofA SOFR Overnight Rate Index[3]	2,40 %	0,85 %[2]
Auf AUD lautende Klassen		
Class Z AUD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 18. Mrz. 2014)	2,14 %	2,74 %
Bloomberg AusBond Bank Bills Index	1,70 %	1,62 %
Auf CAD lautende Klassen		
Institutional CAD (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 21. Sep. 2018)	2,18 %	0,62 %
Canadian Overnight Repo Rate (CORRA)[4]	2,25 %	1,36 %
Auf CHF lautende Klassen		
Institutional CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 08. Sep. 2010)	0,40 %	(0,03 %)
Class E CHF (Hedged), thesaurierende Anteile (Auflegung: 18. Apr. 2011)	0,00 %	(0,99 %)
ICE BofA SARON Overnight Rate Index[5]	0,61 %	(0,39 %)[2]
Auf EUR lautende Klassen		
Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 21. Mai 2009)	1,27 %	1,30 %
Institutional EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 23. Dez. 2009)	1,34 %	0,89 %
Investor EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 31. Jan. 2011)	1,09 %	0,15 %
Administrative EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 21. Jan. 2010)	0,99 %	0,32 %
Class E EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 20. Nov. 2009)	0,85 %	(0,01 %)
G Retail EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 14. Dez. 2010)	0,89 %	(0,35 %)
Euro Short-Term Rate (ESTER) Index[6]	1,34 %	0,10 %[2]
Auf GBP lautende Klassen		
Institutional GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 15. Dez. 2009)	2,07 %	1,55 %
Institutional GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 27. Feb. 2012)	2,09 %	1,17 %
Class E GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 18. Mrz. 2010)	1,61 %	0,52 %
ICE BofA SONIA Overnight Rate Index[7]	2,06 %	0,67 %[2]
Auf NOK lautende Klassen		
Institutional NOK (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 11. Apr. 2011)	1,49 %	1,67 %
1 Month NIBOR Rate Index	1,64 %	1,36 %
Auf SEK lautende Klassen		
Administrative SEK (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 18. Nov. 2011)	1,17 %	0,32 %
ICE BofA SOFR Overnight Rate Index (SEK Hedged)[3]	1,39 %	0,32 %

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

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

3 *Die Wertentwicklung des Vergleichsindex für den Dynamic Bond Fund repräsentiert Folgendes: Auflegung bis 30. Juni 2022: 1 Month USD LIBOR Index; ab 01. Juli 2022: ICE BofA SOFR Overnight Rate Index*

4 *Die Wertentwicklung des Vergleichsindex für den Dynamic Bond Fund repräsentiert Folgendes: Auflegung bis zum 30. Juni 2022: 1 Month LIBOR Index (CAD Hedged); ab 01. Juli 2022: Canadian Overnight Repo Rate (CORRA)*

5 *Die Wertentwicklung des Vergleichsindex für den Dynamic Bond Fund repräsentiert Folgendes: Auflegung bis 30. Juni 2021: 1 Month CHF LIBOR Index; ab 01. Juli 2021: ICE BofA SARON Overnight Rate Index*

6 *Die Wertentwicklung des Vergleichsindex für den Dynamic Bond Fund repräsentiert Folgendes: Auflegung bis 30. Juni 2021: 1 Month Euribor Index; ab 01. Juli 2021: Euro Short-Term Rate (ESTER) Index*

7 *Die Wertentwicklung des Vergleichsindex für den Dynamic Bond Fund repräsentiert Folgendes: Auflegung bis 30. Juni 2021: 1 Month GBP LIBOR Index; ab 01. Juli 2021: ICE BofA SONIA Overnight Rate Index*

Anlageziel und Überblick über die Strategie

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

Kommentare zum Fonds

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

» Das Long-Engagement in brasilianische Zinsen trug zur Wertentwicklung bei, da die brasilianischen Zinsen fielen.

» Das Long-Engagement in Unternehmensanleihen mit Investment Grade trug zur Wertentwicklung bei, da sich die Spreads auf diese Wertpapiere verengten.

» Das Long-Engagement in den brasilianischen Real trug zur Wertentwicklung bei, da die Währung gegenüber dem US-Dollar an Wert verlor.

» Das Long-Engagement in US-Duration schmälerte die Wertentwicklung, da die US-Zinsen anstiegen.

» Das Short-Engagement in polnische Zinsen war der Wertentwicklung abträglich, da die polnischen Zinsen fielen.

» Das Long-Engagement in den japanischen Yen schmälerte die Wertentwicklung, da die Währung gegenüber dem US-Dollar an Wert verlor.

Gesamtrendite, ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2023 abgelaufenen Berichtszeitraum[1]

	6 Monate	Auflegung von Klassen
Auf EUR lautende Klassen		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 25. Feb. 2016)	(1,59 %)	2,21 %
Institutional, ausschüttend II (Auflegung: 25. Feb. 2016)	(1,66 %)	2,21 %
Investor, thesaurierend (Auflegung 14. Aug. 2020)	(1,82 %)	(3,04 %)
Class E, thesaurierend (Auflegung: 25. Feb. 2016)	(2,16 %)	1,15 %
Class E, ausschüttend (Auflegung 10. Sep. 2020)	(2,15 %)	(3,50 %)
Class T, thesaurierend (Auflegung: 20. Okt. 2016)	(2,34 %)	0,03 %
Class Z, thesaurierend (Auflegung: 01. Aug. 2019)	(1,21 %)	1,55 %
Euro Short-Term Rate (ESTER) Index[3]	1,34 %	(0,16 %)[2]
Auf AUD lautende Klassen		
BM Retail AUD (Hedged) Income II (Auflegung: 28. Apr. 2022)	(2,25 %)	(7,71 %)
M Retail AUD (Hedged) Income II (Auflegung: 08. Apr. 2021)	(1,70 %)	(7,19 %)
Bloomberg AusBond Bank Bills Index	1,70 %	1,34 %[2]
Auf CHF lautende Klassen		
Institutional CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 14. Mrz. 2018)	(2,52 %)	0,08 %
ICE BofA SARON Overnight Rate Index[4]	0,61 %	(0,49 %)
Auf GBP lautende Klassen		
Institutional GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 25. Feb. 2016)	(0,95 %)	3,07 %
Institutional GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 29. Jan. 2019)	(0,96 %)	2,31 %
ICE BofA SONIA Overnight Rate Index[5]	2,06 %	0,78 %[2]
Auf ILS lautende Klassen		
Institutional ILS (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 27. Sep. 2022)	(1,11 %)	(1,70 %)
SHIR Shekel Overnight Risk Free Rate	2,13 %	2,88 %
Auf SGD lautende Klassen		
Institutional SGD (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 30. Jul. 2021)	(1,14 %)	(7,23 %)
M Retail SGD (Hedged), ausschüttend II (Auflegung 18. Dez. 2020)	(1,59 %)	(5,41 %)
SORA Singapore Interbank Overnight Rate Average	1,82 %	1,41 %[2]
Auf USD lautende Klassen		
Institutional USD (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 25. Feb. 2016)	(0,37 %)	4,29 %
Institutional USD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Apr. 2021)	(0,42 %)	(5,50 %)
Investor USD (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 11. Mai 2021)	(0,45 %)	(5,36 %)
BM Retail USD (Hedged) Income II (Auflegung: 28. Apr. 2022)	(1,34 %)	(6,30 %)
Class E USD (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 15. Mrz. 2017)	(0,78 %)	2,16 %
E Class USD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 18. Mrz. 2021)	(0,90 %)	(5,63 %)
E Class USD (Hedged) Income II (Auflegung: 09. Sep. 2021)	(0,82 %)	(8,68 %)
H Institutional USD (Hedged), thesaurierend (Auflegung 05. Aug. 2020)	(0,42 %)	(1,65 %)
M Retail USD (Hedged), ausschüttend II (Auflegung 08. Jan. 2020)	(0,85 %)	0,33 %
T Class USD (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 09. Sep. 2021)	(1,06 %)	(9,09 %)
ICE BofA SOFR Overnight Rate Index[6]	2,40 %	1,44 %[2]

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

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

3 *Die Wertentwicklung des Vergleichsindex für den Dynamic Multi-Asset Fund repräsentiert Folgendes: Auflegung bis 30. Juni 2021: 1 Month Euribor Index; ab 01. Juli 2021: Euro Short-Term Rate (ESTER) Index*

4 *Die Wertentwicklung des Vergleichsindex für den Dynamic Multi-Asset Fund repräsentiert Folgendes: Auflegung bis 30. Juni 2021: 1 Month CHF LIBOR Index; ab 01. Juli 2021: ICE BofA SARON Overnight Rate Index*

5 *Die Wertentwicklung des Vergleichsindex für den Dynamic Multi-Asset Fund repräsentiert Folgendes: Auflegung bis 30. Juni 2021: 1 Month GBP LIBOR Index; ab 01. Juli 2021: ICE BofA SONIA Overnight Rate Index*

6 *Die Wertentwicklung des Vergleichsindex für den Dynamic Multi-Asset Fund repräsentiert Folgendes: Auflegung bis 30. Juni 2022: 1 Month USD LIBOR Index; ab 01. Juli 2022: ICE BofA SOFR Overnight Rate Index*

Anlageziel und Überblick über die Strategie

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

Kommentare zum Fonds

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

» Das Long-Engagement in ausgewählten Währungen von Schwellenländern trug zur Rendite bei, da die Währungen gegenüber dem Euro an Wert zulegte.

» Das Long-Engagement in taiwanesischen Aktien trug zur Rendite bei, da die Kurse stiegen.

» Das Long-Engagement in südkoreanischen Aktien trug zur Rendite bei, da die Kurse stiegen.

» Das Short-Engagement in US-Aktien belastete die Rendite, da die Kurse stiegen.

» Das Short-Engagement in europäischen Aktien belastete die Rendite, da die Kurse stiegen.

» Das Long-Engagement in chinesischen Aktien belastete die Rendite, da die Kurse fielen.

Gesamtrendite, ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2023 abgelaufenen Berichtszeitraum[1]

	6 Monate	Auflegung von Klassen
Auf USD lautende Klassen		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 11. Dez. 2007)	9,42 %	2,10 %
Institutional, ausschüttend (Auflegung: 18. Apr. 2008)	9,46 %	1,90 %
Investor, thesaurierend (Auflegung: 18. Aug. 2010)	9,13 %	0,31 %
Class E, thesaurierend (Auflegung: 19. Nov. 2008)	8,83 %	2,83 %
Class E, ausschüttend (Auflegung 08. Jul. 2010)	8,84 %	0,01 %
H Institutional, thesaurierend (Auflegung: 26. Feb. 2021)	9,21 %	(1,21 %)
Class Z, ausschüttend (Auflegung: 18. Nov. 2008)	9,81 %	4,70 %
JPMorgan Government Bond Index-Emerging Markets Global Diversified Index (Unhedged)	7,79 %	1,86 %[2]
Auf EUR lautende Klassen		
Institutional EUR (Unhedged), thesaurierend (Auflegung: 16. Apr. 2010)	7,05 %	2,56 %
Institutional EUR (Unhedged), ausschüttend (Auflegung: 23. Jun. 2010)	6,94 %	2,00 %
Investor EUR (Unhedged), thesaurierend (Auflegung: 20. Dez. 2019)	6,80 %	(0,28 %)
Class E EUR (Unhedged), thesaurierend (Auflegung: 02. Jul. 2009)	6,41 %	2,99 %
Class E EUR (Unhedged), ausschüttend (Auflegung: 12. Dez. 2018)	6,46 %	2,79 %
JPMorgan Government Bond Index-Emerging Markets Global Diversified Index (EUR Unhedged)	5,45 %	3,71 %[2]
Auf GBP lautende Klassen		
Institutional GBP (Unhedged), thesaurierend (Auflegung: 27. Jun. 2008)	3,52 %	5,22 %
JPMorgan Government Bond Index-Emerging Markets Global Diversified Index (GBP Unhedged)	1,99 %	4,93 %

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

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

Anlageziel und Überblick über die Strategie

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

Kommentare zum Fonds

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

» Die Übergewichtung des Engagements in lokaler dominikanischer Duration trug zur relativen Wertentwicklung bei, da die lokalen dominikanischen Renditen sanken.

» Die Untergewichtung des Engagements in die türkische Lira trug zur Wertentwicklung bei, da die türkische Währung an Wert verlor.

» Die Untergewichtung des Engagements in das ägyptischen Pfund trug zur Wertentwicklung bei, da die ägyptische Währung an Wert verlor.

» Das Altengagement in russischen Lokalwährungsanleihen war der Wertentwicklung abträglich, da der russische Rubel an Wert verlor.

» Die Untergewichtung des Engagements in mexikanischer Duration in Landeswährung im langen Bereich schmälerte die Wertentwicklung, da die mexikanischen Renditen fielen.

Gesamtrendite, ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2023 abgelaufenen Berichtszeitraum[1]

	6 Monate	Auflegung von Klassen
Auf USD lautende Klassen		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 27. Jul. 2022)	9,56 %	15,80 %
Institutional, ausschüttend (Auflegung: 27. Jul. 2022)	9,56 %	15,81 %
Investor, thesaurierend (Auflegung: 27. Jul. 2022)	9,28 %	15,40 %
Investor, ausschüttend (Auflegung: 27. Jul. 2022)	9,37 %	15,44 %
E Class, thesaurierend (Auflegung: 27. Jul. 2022)	8,93 %	14,70 %
E Class, ausschüttend (Auflegung: 27. Jul. 2022)	9,02 %	14,75 %
Class Z, thesaurierend (Auflegung: 23. Sep. 2022)	10,03 %	18,50 %
JPMorgan ESG Government Bond Index-Emerging Markets Global Diversified Index	8,87 %	14,99 %[2]
Auf EUR lautende Klassen		
Institutional EUR (Unhedged), thesaurierend (Auflegung: 27. Jul. 2022)	7,19 %	7,40 %
Institutional EUR (Unhedged), ausschüttend (Auflegung: 27. Jul. 2022)	7,07 %	7,37 %
Investor EUR (Unhedged), thesaurierend (Auflegung: 27. Jul. 2022)	6,89 %	7,00 %
Investor EUR (Unhedged), ausschüttend (Auflegung: 27. Jul. 2022)	6,89 %	7,02 %
E Class EUR (Unhedged), thesaurierend (Auflegung: 27. Jul. 2022)	6,61 %	6,40 %
E Class EUR (Unhedged), ausschüttend (Auflegung: 27. Jul. 2022)	6,65 %	6,39 %
JPMorgan ESG Government Bond Index-Emerging Markets Global Diversified Index (EUR Unhedged)	6,50 %	6,67 %
Auf GBP lautende Klassen		
Institutional GBP (Unhedged), ausschüttend (Auflegung: 28. Jun. 2023)	—	(0,70 %)
JPMorgan ESG Government Bond Index-Emerging Markets Global Diversified Index (GBP Unhedged)	3,00 %	(0,62 %)

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

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

Anlageziel und Überblick über die Strategie

Das Anlageziel des Emerging Local Bond ESG Fund ist es, die Erträge mit umsichtiger Anlageverwaltung zu maximieren. Der Fonds investiert normalerweise mindestens 80 % des Vermögens in festverzinsliche Anlagen, die auf Währungen von Ländern mit Wertpapiermärkten in Schwellenländern lauten. Der Fonds ist bestrebt, unter normalen Marktbedingungen ökologische und soziale Merkmale zu bewerben (wie in der Ergänzung für den Fonds dargelegt) und einen Teil des Vermögens in nachhaltige Anlagen zu investieren.

Kommentare zum Fonds

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

» Die Übergewichtung des Engagements in lokaler dominikanischer Duration trug zur relativen Wertentwicklung bei, da die lokalen dominikanischen Renditen sanken.

» Die Untergewichtung des Engagements in die türkische Lira trug zur Wertentwicklung bei, da die türkische Währung an Wert verlor.

» Die Übergewichtung des Engagements in die chilenische Durationskurve in Landeswährung im 10-Jahres-Bereich förderte die Wertentwicklung, da die chilenischen Renditen fielen.

» Die Übergewichtung des Engagements in den malaysischen Ringgit schmälerte die Wertentwicklung, da die Währung an Wert verlor.

» Die Untergewichtung des Engagements in die mexikanische Durationskurve in Landeswährung im 5-Jahres-Bereich schmälerte die Wertentwicklung, da die mexikanischen Renditen fielen.

Gesamtrendite, ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2023 abgelaufenen Berichtszeitraum[1]

	6 Monate	Auflegung von Klassen
Auf USD lautende Klassen		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 31. Jul. 2001)	4,19 %	7,32 %
Institutional, ausschüttend (Auflegung: 13. Dez. 2001)	4,15 %	6,70 %
Investor, thesaurierend (Auflegung: 25. Apr. 2002)	4,00 %	5,97 %
Administrative, thesaurierend (Auflegung: 29. Mai 2003)	3,94 %	4,91 %
BM Retail, ausschüttend II (Auflegung: 28. Apr. 2022)	3,22 %	(2,47 %)
Class E, thesaurierend (Auflegung: 31. Mrz. 2006)	3,72 %	3,61 %
Class E, ausschüttend (Auflegung: 28. Okt. 2005)	3,71 %	3,77 %
H Institutional, thesaurierend (Auflegung: 17. Okt. 2002)	4,09 %	6,85 %
H Institutional, ausschüttend (Auflegung 03. Sep. 2020)	4,03 %	(4,84 %)
M Retail, ausschüttend (Auflegung: 30. Nov. 2010)	3,72 %	2,26 %
M Retail, ausschüttend II (Auflegung: 23. Dez. 2013)	3,76 %	1,48 %
Class Z, ausschüttend (Auflegung: 18. Nov. 2008)	4,56 %	6,85 %
JPMorgan Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global	3,81 %	6,59 %[2]
Auf AUD lautende Klassen		
M Retail AUD (Hedged) ausschüttend (Auflegung 19. Dez. 2012)	2,74 %	0,85 %
JPMorgan Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global (AUD Hedged)	2,80 %	1,73 %
Auf CHF lautende Klassen		
Institutional CHF (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 16. Dez. 2005)	2,03 %	2,59 %
JPMorgan Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global (CHF Hedged)	1,58 %	2,76 %
Auf EUR lautende Klassen		
Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 17. Dez. 2002)	2,88 %	5,29 %
Institutional EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 20. Dez. 2010)	2,87 %	1,85 %
Investor EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 20. Dez. 2019)	2,70 %	(4,89 %)
Class E EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 31. Mrz. 2006)	2,46 %	2,31 %
JPMorgan Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global (EUR Hedged)	2,46 %	5,17 %[2]
Auf EUR lautende Klassen (nicht abgesichert)		
Institutional EUR (Unhedged), thesaurierend (Auflegung: 09. Feb. 2018)	1,87 %	2,56 %
JPMorgan Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global (EUR Unhedged)	1,55 %	2,44 %
Auf GBP lautende Klassen		
Institutional GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 05. Feb. 2004)	3,66 %	4,98 %
Institutional GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Dez. 2005)	3,73 %	4,00 %
JPMorgan Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global (GBP Hedged)	3,21 %	5,20 %[2]
Auf SGD lautende Klassen		
Institutional SGD (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 02. Jul. 2018)	3,54 %	0,46 %
Class E SGD (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 15. Feb. 2007)	3,11 %	2,71 %
JPMorgan Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global (SGD Hedged)	3,14 %	3,98 %[2]

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

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

Anlageziel und Überblick über die Strategie

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

Kommentare zum Fonds

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

» Die Übergewichtung des Engagements in ukrainische Staatsanleihen und Quasistaatsanleihen trug zur relativen Wertentwicklung bei, da sich die Spreads verengten.

» Die Übergewichtung des Engagements in nigerianische Staatsanleihen und Quasistaatsanleihen trug zur relativen Wertentwicklung bei, da sich die Spreads verengten.

» Die Übergewichtung des Engagements in sri-lankische Staatsanleihen trug zur relativen Wertentwicklung bei, da sich die Spreads verengten.

» Die Untergewichtung des Engagements in Spreads auf Spreads von Schwellenländern schmälerte die Wertentwicklung, da die Spreads schrumpften.

» Die Übergewichtung des Engagements in ägyptische Staatsanleihen schmälerte die Wertentwicklung, da sich die Spreads erweiterten.

Gesamtrendite, ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2023 abgelaufenen Berichtszeitraum[1]

	6 Monate	Auflegung von Klassen
Auf USD lautende Klassen		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 16. Apr. 2010)	4,31 %	2,99 %
Institutional, ausschüttend (Auflegung: 10. Jul. 2019)	4,37 %	(2,45 %)
Administrative, thesaurierend (Auflegung: 10. Jun. 2019)	4,10 %	(2,94 %)
Administrative, ausschüttend (Auflegung: 10. Jul. 2019)	4,10 %	(2,95 %)
E Class, thesaurierend (Auflegung: 05. Feb. 2021)	4,02 %	(8,79 %)
E Class, ausschüttend (Auflegung: 05. Feb. 2021)	3,86 %	(8,85 %)
Class Z, thesaurierend (Auflegung: 01. Mrz. 2023)	—	3,90 %
JPMorgan ESG Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global Diversified[3]	3,91 %	3,46 %[2]
Auf CHF lautende Klassen		
Institutional CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 09. Apr. 2021)	2,04 %	(9,59 %)
JPMorgan ESG Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global Diversified (CHF Hedged)[3]	1,68 %	(9,25 %)
Auf EUR lautende Klassen		
Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 16. Okt. 2013)	3,09 %	0,02 %
Institutional EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Okt. 2017)	3,06 %	(2,81 %)
Class E EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 31. Aug. 2018)	2,59 %	(2,84 %)
JPMorgan ESG Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global Diversified (EUR Hedged)[3]	2,56 %	0,51 %[2]
Auf GBP lautende Klassen		
Institutional GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 12. Dez. 2019)	3,84 %	(4,36 %)
JPMorgan ESG Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global Diversified (GBP Hedged)[3]	3,31 %	(4,64 %)
Auf GBP lautende Klassen (nicht abgesichert)		
Institutional GBP (Unhedged), ausschüttend (Auflegung 11. Dez. 2020)	(1,28 %)	(5,92 %)
JPMorgan ESG Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global Diversified (GBP Unhedged)[3]	(1,68 %)	(5,61 %)
Auf NOK lautende Klassen		
Investor NOK (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 17. Mrz. 2014)	3,13 %	0,76 %
JPMorgan ESG Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global Diversified (NOK Hedged)[3]	2,86 %	1,31 %
Auf SEK lautende Klassen		
Investor SEK (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 06. Feb. 2014)	3,06 %	(0,22 %)
Administrative SEK (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 08. Okt. 2021)	2,98 %	(12,16 %)
JPMorgan ESG Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global Diversified (SEK Hedged)[3]	2,82 %	0,55 %[2]

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

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

[3] *Die Wertentwicklung des Vergleichsindex für den Emerging Markets Bond ESG Fund repräsentiert Folgendes: Auflegung bis 01. August 2019: JPMorgan Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global, bereinigt um den Filter Socially Responsible Investment (SRI); ab 02. August 2019: JPMorgan ESG Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global Diversified*

Anlageziel und Überblick über die Strategie

Der Emerging Markets Bond ESG Fund ist bestrebt, bei gleichzeitigem Kapitalerhalt, einer umsichtigen Anlageverwaltung und nachhaltigen Anlagen (durch die ausdrückliche Einbeziehung von Umwelt-, Sozial- und Unternehmungsführungsfaktoren in den Anlageprozess, wie in der Ergänzung näher dargelegt) die maximal mögliche Rendite zu erzielen. Dazu werden mindestens 80 % des Vermögens in ein aktiv verwaltetes, diversifiziertes Portfolio aus festverzinslichen Anlagen (wie im Prospekt angegeben) angelegt, die wirtschaftlich mit Schwellenmarktländern verbunden sind. Die Beteiligung an solchen Emittenten lässt sich über die direkte Anlage in Rentenpapiere (wie im Verkaufsprospekt definiert) oder über den Einsatz von derivativen Finanzinstrumenten (wie im Fondsnachtrag näher definiert) erreichen. Alle Wertpapiere werden gemäß dem internen verantwortungsbezogenen Auswahlverfahren der Anlageberatungsgesellschaft ausgewählt, das darauf ausgelegt ist, SGU-Faktoren (Umwelt, Soziales und Unternehmensführung) zu berücksichtigen, und das unter anderem ein ethisches Auswahlverfahren umfasst, das die sozial verantwortliche Anlageberatungsgesellschaft (wie im Prospekt angegeben) von Zeit zu Zeit vorgibt.

Kommentare zum Fonds

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

» Die Übergewichtung des Engagements in ukrainische Unternehmensanleihen trug zur relativen Wertentwicklung bei, da sich die Spreads verengten.

» Die Übergewichtung des Engagements in dominikanischer Duration trug zur relativen Wertentwicklung bei, da die Zinssätze fielen.

» Die Übergewichtung des Engagements in sri-lankische Staatsanleihen trug zur relativen Wertentwicklung bei, da sich die Spreads verengten.

» Die Untergewichtung des Engagements in Spreads auf Spreads von Schwellenländern schmälerte die Wertentwicklung, da die Spreads schrumpften.

» Die Übergewichtung des Engagements in ägyptische Staatsanleihen schmälerte die Wertentwicklung, da sich die Spreads erweiterten.

Gesamtrendite, ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2023 abgelaufenen Berichtszeitraum[1]

	6 Monate	Auflegung von Klassen
Auf USD lautende Klassen		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 12. Nov. 2009)	1,81 %	3,39 %
Class E, thesaurierend (Auflegung: 27. Feb. 2012)	1,37 %	1,52 %
JPMorgan Corporate Emerging Markets Bond Index Diversified (CEMBI)	3,27 %	4,69 %[2]
Auf CHF lautende Klassen		
Class E CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 25. Mai 2012)	(0,83 %)	(0,39 %)
JPMorgan Corporate Emerging Markets Bond Diversified Index (CHF Hedged)	1,08 %	1,75 %
Auf EUR lautende Klassen		
Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 19. Feb. 2010)	0,62 %	2,00 %
Class E EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 02. Mrz. 2010)	0,18 %	0,97 %
JPMorgan Corporate Emerging Markets Bond Diversified Index (EUR Hedged)	1,97 %	3,23 %[2]

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

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

Anlageziel und Überblick über die Strategie

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

Kommentare zum Fonds

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

» Die Titelauswahl bei ukrainischen Unternehmensanleihen trug zur Wertentwicklung bei, da die Kurse ausgewählter Wertpapiere stiegen.

» Die Titelauswahl bei saudi-arabischen Unternehmensanleihen trug zur Wertentwicklung bei, da die Kurse ausgewählter Wertpapiere stiegen.

» Die Titelauswahl bei brasilianischen Unternehmensanleihen belastete die Wertentwicklung, da die Kurse für einen ausgewählten Emittenten nachgaben.

» Das Altengagement in russische Staatsanleihen war der relativen Wertentwicklung abträglich, da russische Unternehmensanleihen die Wertentwicklung des Index unterschritten.

» Die Titelauswahl bei chinesischen Unternehmen war der Wertentwicklung abträglich, da ausgewählte Immobilienwerte unter Kursrückgängen litten.

Gesamtrendite, ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2023 abgelaufenen Berichtszeitraum[1]

	6 Monate	Auflegung von Klassen
Auf USD lautende Klassen		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 04. Jun. 2019)	5,86 %	2,00 %
Class Z, thesaurierend (Auflegung: 08. Jun. 2022)	6,19 %	6,03 %
50 % JPMorgan EMBI Global Index / 50 % JPMorgan Government Bond Index-Emerging Markets Global Diversified Index (USD) Unhedged	5,80 %	(0,78 %)[2]
Auf EUR lautende Klassen		
Institutional EUR (Partially Hedged), thesaurierend (Auflegung: 04. Jun. 2019)	4,01 %	0,29 %
E Class EUR (Partially Hedged), thesaurierend (Auflegung: 19. Apr. 2022)	3,53 %	(2,68 %)
50 % JPMorgan EMBI Global Index (EUR Hedged) / 50 % JPMorgan Government Bond Index-Emerging Markets Global Diversified Index (EUR Unhedged)	3,96 %	(1,43 %)[2]
Auf GBP lautende Klassen		
Institutional GBP (Partially Hedged), ausschüttend (Auflegung: 29. Mrz. 2022)	3,52 %	(0,80 %)
50 % JPMorgan EMBI Global Index (GBP Hedged) / 50 % JPMorgan Government Bond Index-Emerging Markets Global Diversified Index (GBP Unhedged)	2,61 %	(0,45 %)

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

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

Anlageziel und Überblick über die Strategie

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

Kommentare zum Fonds

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

» Die Untergewichtung des Engagements in US-Duration schmälerte die Wertentwicklung, da die US-Renditen einen Aufschwung erlebten.

» Die Übergewichtung des Engagements in lokaler dominikanischer Duration trug zur relativen Wertentwicklung bei, da die lokalen dominikanischen Renditen sanken.

» Die Untergewichtung des Engagements in den südafrikanischen Rand trug zur Wertentwicklung bei, da die Währung an Wert verlor.

» Die Übergewichtung des Engagements in den polnischen Złoty schmälerte die Wertentwicklung, da die Währung an Wert zulegte.

» Die Untergewichtung des Engagements in die tschechische Krone schmälerte die Wertentwicklung, da die Währung an Wert zulegte.

Gesamtrendite, ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2023 abgelaufenen Berichtszeitraum[1]

	6 Monate	Auflegung von Klassen
Auf USD lautende Klassen		
Class E, thesaurierend (Auflegung: 19. Nov. 2008)	4,73 %	1,32 %
JPMorgan Emerging Local Markets Index Plus (Unhedged)	3,96 %	1,20 %
Auf EUR lautende Klassen		
Institutional EUR (Unhedged), thesaurierend (Auflegung: 20. Jan. 2010)	2,91 %	2,80 %
Class E EUR (Unhedged), thesaurierend (Auflegung: 02. Jul. 2009)	2,40 %	2,26 %
JPMorgan Emerging Local Markets Index Plus (EUR Unhedged)	1,70 %	2,82 %[2]

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

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

Anlageziel und Überblick über die Strategie

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

Kommentare zum Fonds

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

» Die Untergewichtung des Engagements in die türkische Lira trug zur Wertentwicklung bei, da die türkische Währung an Wert verlor.

» Das nicht im Vergleichsindex enthaltene Engagement in lokaler dominikanischer Duration trug zur relativen Wertentwicklung bei, da die lokalen dominikanischen Renditen sanken.

» Die Übergewichtung des Engagements in den kolumbianischen Peso trug zur Wertentwicklung bei, da die kolumbianische Währung an Wert zulegte.

» Die Untergewichtung des Engagements in lokaler polnischer Duration schmälerte die Wertentwicklung, da die Renditen nachgaben.

» Das nicht im Vergleichsindex enthaltene Engagement in brasilianischen Unternehmensanleihen beeinträchtigten die Wertentwicklung, da ausgewählte Wertpapiere Kursrückgänge verzeichneten.

Gesamtrendite, ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2023 abgelaufenen Berichtszeitraum[1]

	6 Monate	Auflegung von Klassen
Auf USD lautende Klassen		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 29. Apr. 2021)	1,49 %	(2,05 %)
Institutional, ausschüttend (Auflegung: 29. Apr. 2021)	1,54 %	(2,05 %)
E Class, thesaurierend (Auflegung: 29. Apr. 2021)	1,08 %	(2,91 %)
E Class, ausschüttend (Auflegung: 29. Apr. 2021)	1,06 %	(2,93 %)
Bloomberg U.S. Aggregate Index	2,09 %	(4,80 %)
Auf AUD lautende Klassen		
Institutional AUD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 19. Nov. 2021)	0,62 %	(4,31 %)
R Class AUD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 29. Apr. 2021)	0,52 %	(3,16 %)
Bloomberg U.S. Aggregate (AUD Hedged) Index	1,13 %	(5,88 %)[2]
Auf CHF lautende Klassen		
Institutional CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 29. Apr. 2021)	(0,66 %)	(4,50 %)
E Class CHF (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 29. Apr. 2021)	(1,11 %)	(5,32 %)
Bloomberg U.S. Aggregate (CHF Hedged) Index	(0,16 %)	(7,40 %)
Auf EUR lautende Klassen		
Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 29. Apr. 2021)	0,22 %	(3,82 %)
Institutional EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 21. Mai 2021)	0,25 %	(3,96 %)
E Class EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 25. Jun. 2021)	(0,11 %)	(5,20 %)
E Class EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 29. Apr. 2021)	(0,20 %)	(4,67 %)
Bloomberg U.S. Aggregate (EUR Hedged) Index	0,74 %	(6,73 %)[2]
Auf GBP lautende Klassen		
Institutional GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 29. Apr. 2021)	1,07 %	(2,74 %)
Bloomberg U.S. Aggregate (GBP Hedged) Index	1,51 %	(5,64 %)
Auf NOK lautende Klassen		
Institutional NOK (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 01. Mrz. 2023)	—	0,29 %
Bloomberg U.S. Aggregate (NOK Hedged) Index	1,12 %	1,64 %
Auf SEK lautende Klassen		
Institutional SEK (Hedged), thesaurierend (Auflegung 29. Okt. 2021)	0,36 %	(4,83 %)
Administrative SEK (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 12. Mai 2022)	0,11 %	(2,35 %)
Bloomberg U.S. Aggregate (SEK Hedged) Index	0,99 %	(8,72 %)[2]
Auf SGD lautende Klassen		
Institutional SGD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 29. Apr. 2021)	0,98 %	(2,34 %)
Bloomberg U.S. Aggregate (SGD Hedged) Index	1,40 %	(5,22 %)

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

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

Anlageziel und Überblick über die Strategie

Der PIMCO ESG Income Fund strebt hohe laufende Erträge an, die mit einer umsichtigen Anlageverwaltung und nachhaltigen Anlagen vereinbar sind (durch die explizite Einbindung von Umwelt-, Sozial- und Unternehmungsführungsfaktoren („SGU“) in den Anlageprozess, wie in der Ergänzung näher dargelegt). Der langfristige Kapitalzuwachs gilt als sekundäres Anlageziel.

Kommentare zum Fonds

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

» Das Long-Engagement in Investitionskredite trug zur Wertentwicklung bei, da sich die Spreads auf diese Wertpapiere verengten.

» Das Long-Engagement in Hochzinsanleihen trug zur Wertentwicklung bei, da sich die Spreads auf diese Wertpapiere verengten.

» Die Position in hypothekenbesicherten Wertpapieren ohne Agency-Schuldtitel trugen zur relativen Wertentwicklung bei, da die Spreads auf diese Wertpapiere schrumpften.

» Das Long-Engagement in US-Duration schmälerte die Wertentwicklung, da die US-Renditen anstiegen.

» Die Position in gewerblichen hypothekenbesicherten Wertpapieren und in solchen ohne Agency-Schuldtitel dämpften die relative Wertentwicklung, da sich die Spreads auf diese Wertpapiere ausweiteten.

Gesamtrendite, ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2023 abgelaufenen Berichtszeitraum[1]

	6 Monate	Auflegung von Klassen
Auf EUR lautende Klassen		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 31. Dez. 1998)	2,18 %	3,28 %
Institutional, ausschüttend (Auflegung: 07. Jan. 2003)	2,09 %	2,92 %
Investor, thesaurierend (Auflegung: 08. Mai 2002)	1,99 %	2,86 %
Class E, thesaurierend (Auflegung: 31. Mrz. 2006)	1,73 %	1,56 %
Class E, ausschüttend (Auflegung: 10. Okt. 2005)	1,70 %	1,35 %
FTSE Euro Broad Investment-Grade Index	2,33 %	3,09 %[2]
Auf CHF lautende Klassen		
Institutional CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 30. Jun. 2006)	1,26 %	1,69 %
FTSE Euro Broad Investment-Grade (CHF Hedged) Index	1,44 %	1,73 %

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

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

Anlageziel und Überblick über die Strategie

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

Kommentare zum Fonds

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

» Die Untergewichtung des Engagements in Eurozonen-Duration (größtenteils aus dem kurzen und sehr langen Bereich der Kurve), und gleichzeitig eine Übergewichtung in der Mitte trugen zur relativen Wertentwicklung bei, da die Zinsen im kurzen und sehr langen Bereich der Kurve anstiegen, während sie in der Mitte fielen.

» Das Long-Engagement in verbrieften Produkten, insbesondere in britischen Residential Mortgage-Backed Securitys und in europäischen hochwertigen besicherten Darlehensobligationen, trug zur relativen Wertentwicklung bei, da sich die Spreads verengten.

» Die Titelauswahl bei vorrangigen Finanzwerten trug zur relativen Wertentwicklung bei, da das Engagement in Anleihen ausgewählter Finanz- und Makleremittenten eine Outperformance erzielte.

» Die Titelauswahl bei nachrangigen Finanztiteln war der relativen Wertentwicklung abträglich, da das Engagement in einer ausgewählten Schweizer Bank eine Underperformance zeigte.

» Das Short-Engagement in japanischer Duration schmälerte die relative Wertentwicklung, da die Zinsen einen Abstieg verzeichneten.

» Das Long-Engagement in dänischen Hypotheken war der relativen Wertentwicklung abträglich, da sich die Spreads ausweiteten.

Gesamtrendite, ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2023 abgelaufenen Berichtszeitraum[1]

	6 Monate	Auflegung von Klassen
Auf EUR lautende Klassen		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 31. Jan. 2008)	2,95 %	2,51 %
Institutional, ausschüttend II (Auflegung: 01. Okt. 2013)	2,98 %	0,99 %
Class E, thesaurierend (Auflegung: 25. Mai 2010)	2,50 %	1,05 %
H Institutional, thesaurierend (Auflegung: 07. Jun. 2019)	3,03 %	(2,99 %)
H Institutional, ausschüttend II (Auflegung: 07. Jun. 2019)	2,99 %	(3,00 %)
Bloomberg Euro-Aggregate Credit Index	2,10 %	2,35 %[2]

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

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

Anlageziel und Überblick über die Strategie

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

Kommentare zum Fonds

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

» Makrostrategien und insbesondere die Positionierung in EUR- und USD-Duration trugen zur Wertentwicklung bei, da die Zinssätze stiegen und sich beide Kurven weiter umkehrten.

» Die Wertpapierauswahl bei Banken und Brokerage trug zur Wertentwicklung bei, da die Übergewichtung des Engagements in vorrangigen Schuldtiteln einer Schweizer Bank aufgrund einer Übernahme durch einen höher bewerteten Wettbewerber überdurchschnittlich abschnitt.

» Die Untergewichtung von Staatsanleihen zu Beginn des Jahres trug zur Wertentwicklung bei, da der Sektor aufgrund der erhöhten Angebotserwartungen für 2023 eine Underperformance aufwies.

» Das Engagement in dänischen gedeckten Schuldverschreibungen zu Beginn des Jahres war der Wertentwicklung abträglich, da sich die Spreads ausweiteten.

» Die Titelauswahl im Sektor Versorgung war der Wertentwicklung abträglich, da die Übergewichtung des Engagements in einem ausgewählten britischen Wasserversorger aufgrund von Bedenken hinsichtlich der Finanzlage des Unternehmens eine Underperformance aufwies.

Gesamtrendite, ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2023 abgelaufenen Berichtszeitraum[1]

	6 Monate	Auflegung von Klassen
Auf EUR lautende Klassen		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 28. Feb. 2011)	3,02 %	2,95 %
Institutional, ausschüttend (Auflegung: 28. Feb. 2011)	3,02 %	2,96 %
Investor, thesaurierend (Auflegung: 13. Dez. 2019)	2,92 %	(2,38 %)
Investor, ausschüttend (Auflegung: 29. Mai 2012)	2,83 %	2,54 %
Class E, thesaurierend (Auflegung: 28. Feb. 2011)	2,56 %	2,03 %
Class E, ausschüttend (Auflegung: 28. Feb. 2011)	2,59 %	2,03 %
Class T, thesaurierend (Auflegung: 30. Sep. 2014)	2,39 %	(0,18 %)
Class T, ausschüttend (Auflegung: 30. Sep. 2014)	2,44 %	(0,18 %)
Bloomberg Euro Aggregate 1-10 Year Bond Index	1,65 %	1,53 %[2]

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

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

Anlageziel und Überblick über die Strategie

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

Kommentare zum Fonds

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

» Das Long-Engagement in Schuldtiteln mit Investment Grade und hochverzinslichen Schuldtiteln trug zur Wertentwicklung bei, da sich die Spreads verengten.

» Das Long-Engagement in verbrieften Krediten, insbesondere in hypothekenbesicherten US-Wertpapieren ohne Agency-Schuldtitel, europäischen Residential Mortgage-Backed Securitys und Collateralized Loan Obligations, trugen zur Wertentwicklung bei, da sich die Spreads verengten.

» Das Long-Engagement in einen ausgewählten Korb von Währungen von Schwellenländern trugen zur Wertentwicklung bei, da sie gegenüber dem Euro an Wert zulegten.

» Das Long-Engagement in US-Duration schmälerte die Wertentwicklung, da die US-Zinsen anstiegen.

» Das Long-Engagement in Eurozonen-Duration schmälerte die Wertentwicklung, da die europäischen Zinsen anstiegen.

» Das Short-Engagement in japanischer Duration schmälerte die Wertentwicklung, da die japanischen Zinsen einen Anstieg verzeichneten.

Gesamtrendite, ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2023 abgelaufenen Berichtszeitraum[1]

	6 Monate	Auflegung von Klassen
Auf EUR lautende Klassen		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 21. Apr. 2006)	4,41 %	4,07 %
Bloomberg Euro Government (Deutschland, Frankreich, Niederlande) + 15 Jahre Index[2]	3,66 %	3,00 %

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

[2] *Die Wertentwicklung des Vergleichsindex für den Euro Long Average Duration Fund repräsentiert Folgendes: Auflegung bis 30. März 2011: Citigroup Euro Broad Investment-Grade (EuroBIG) Bond > 15 Years Index; 31. März 2011 bis 30. Januar 2012: Citigroup Euro Broad Investment-Grade (EuroBIG) Bond AAA rated > 15 Years Index; ab 31. Januar 2012: Bloomberg Euro Government (Germany, France, Netherlands) + 15 Years Index*

Anlageziel und Überblick über die Strategie

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

Kommentare zum Fonds

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

» Die Untergewichtung des Engagements in Eurozonen-Duration (hauptsächlich im kurzen Bereich der Kurve) sowie die Instrumentenauswahl leisteten einen positiven Beitrag zur Wertentwicklung, da die Renditen der Eurozone im vorderen Bereich der Kurve anstiegen und in die Höhe schossen.

» Das Long-Engagement in verbrieften Produkten, insbesondere in britischen Residential Mortgage-Backed Securitys und in europäischen hochwertigen besicherten Darlehensobligationen, trug zur relativen Wertentwicklung bei, da sich die Spreads verengten.

» Die Positionierung innerhalb Japans durch eine Untergewichtung in japanischer Duration und eine Übergewichtung des japanischen Yen schmälerte die Wertentwicklung, da die japanischen Zinssätze fielen und der Yen gegenüber dem US-Dollar (der Finanzierungswährung) an Wert verlor.

» Das Long-Engagement in dänischen Hypotheken waren der relativen Wertentwicklung abträglich, da sich die Spreads ausweiteten.

Gesamtrendite, ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2023 abgelaufenen Berichtszeitraum[1]

	6 Monate	Auflegung von Klassen
Auf EUR lautende Klassen		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 31. Jan. 2006)	1,61 %	1,06 %
Class E, thesaurierend (Auflegung: 31. Mrz. 2006)	1,25 %	0,29 %
Euro Short-Term Rate (ESTER) Index[3]	1,34 %	0,76 %[2]

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

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

3 *Die Wertentwicklung des Vergleichsindex für den Euro Short-Term Fund repräsentiert Folgendes: Auflegung bis 30. Juni 2021: 1 Month Euribor Index; ab 01. Juli 2021: Euro Short-Term Rate (ESTER) Index*

Anlageziel und Überblick über die Strategie

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

Kommentare zum Fonds

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

» Das Long-Engagement in verbrieften Krediten, insbesondere in europäischen Residential Mortgage-Backed Securitys und Collateralized Loan Obligations, trug zur Wertentwicklung bei, da sich die Spreads verengten.

» Das Long-Engagement in Unternehmensanleihen mit Investment Grade begünstigte die Wertentwicklung, da sich die Spreads verengten.

» Die Titelauswahl in europäischen gedeckten Schuldverschreibungen wirkte sich positiv auf die Wertentwicklung aus.

» Die Kurvenpositionierung in Eurozonen-Duration schmälerte die Wertentwicklung, da die europäischen Zinsen im vorderen Bereich anstiegen.

» Das Long-Engagement in US-Duration schmälerte die Wertentwicklung, da die US-Zinsen anstiegen.

» Das taktische Engagement in den japanischen Yen schmälerte die Wertentwicklung, da der japanische Yen gegenüber dem Euro an Wert verlor.

Gesamtrendite, ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2023 abgelaufenen Berichtszeitraum[1]

	6 Monate	Auflegung von Klassen
Auf EUR lautende Klassen		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 31. Jan. 2020)	4,73 %	0,55 %
E Class, thesaurierend (Auflegung: 22. Dez. 2022)	4,20 %	4,20 %
E Class, ausschüttend (Auflegung: 17. Apr. 2023)	—	1,35 %
Class Z, thesaurierend (Auflegung: 31. Jan. 2020)	5,06 %	1,10 %
ICE BofA Merrill Lynch BB-B European Currency High Yield Constrained Index	4,44 %	(0,83 %)[2]

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

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

Anlageziel und Überblick über die Strategie

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

Kommentare zum Fonds

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

» Die Titelauswahl im Sektor Gesundheitswesen trug zur Wertentwicklung bei, da die Übergewichtung ausgewählter Emittenten eine Outperformance erzielte, wohingegen die Untergewichtung eines ausgewählten Emittenten eine Underperformance aufwies.

» Die Titelauswahl im Sektor Automobil trug zur Wertentwicklung bei, da sich die Übergewichtung ausgewählter Emittenten überdurchschnittlich entwickelte.

» Die Titelauswahl im Finanzen und Versicherungen trug zur Wertentwicklung bei, da sich ausgewählte Emittenten unterdurchschnittlich entwickelten.

» Die Titelauswahl im Sektor Bankwesen war der Wertentwicklung abträglich, da sich das Engagement in nachrangigen Schuldtiteln und insbesondere in einer ausgewählten Schweizer Bank unterdurchschnittlich entwickelte.

» Die Titelauswahl im Sektor Chemie war der Wertentwicklung abträglich, da die Übergewichtung eines ausgewählten Emittenten zurückblieb.

Gesamtrendite, ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2023 abgelaufenen Berichtszeitraum[1]

	6 Monate	Auflegung von Klassen
Auf EUR lautende Klassen		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 05. Jul. 2011)	0,45 %	0,84 %
Class E, thesaurierend (Auflegung: 25. Mrz. 2013)	0,32 %	(0,55 %)
H Institutional, thesaurierend (Auflegung: 08. Jan. 2020)	0,42 %	(1,20 %)
Euro Short-Term Rate (ESTER) Index[3]	1,35 %	1,05 %[2]

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

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

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

Anlageziel und Überblick über die Strategie

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

Kommentare zum Fonds

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

» Das Long-Engagement in verbrieften Krediten, insbesondere in europäischen Residential Mortgage-Backed Securitys und Collateralized Loan Obligations, trug zur Wertentwicklung bei, da sich die Spreads verengten.

» Das Long-Engagement in vorrangigen Finanztiteln war der Wertentwicklung zuträglich, da sich die Spreads verengten.

» Es gibt ansonsten keine anderen Faktoren, die einen wesentlichen Beitrag zum Fonds leisteten.

» Das Long-Engagement in US-Duration schmälerte die Wertentwicklung, da die US-Zinsen anstiegen.

» Das Short-Engagement in japanischer Duration schmälerte die Wertentwicklung, da die japanischen Zinsen einen Anstieg verzeichneten.

» Das Long-Engagement in dänischen gedeckten Schuldverschreibungen war der Wertentwicklung abträglich, da sich die Spreads ausweiteten.

Gesamtrendite, ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2023 abgelaufenen Berichtszeitraum[1]

	6 Monate	Auflegung von Klassen
Auf USD lautende Klassen		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 09. Jun. 2009)	1,81 %	2,17 %
PIMCO Global Advantage Bond Index (GLADI) (London Close)	2,14 %	1,70 %
Auf CHF lautende Klassen		
Institutional CHF (Partially Hedged), ausschüttend (Auflegung: 02. Aug. 2011)	(0,22 %)	1,06 %
PIMCO Global Advantage Bond Index (GLADI) (CHF, Partially Hedged) (London Close)	0,05 %	0,58 %
Auf EUR lautende Klassen		
Institutional EUR (Partially Hedged), thesaurierend (Auflegung: 24. Mai 2010)	0,70 %	1,99 %
Class E EUR (Partially Hedged), thesaurierend (Auflegung: 06. Mai 2010)	0,26 %	0,99 %
PIMCO Global Advantage Bond Index (GLADI) (EUR, Partially Hedged) (London Close)	1,03 %	1,59 %[2]
Auf NOK lautende Klassen		
Institutional NOK (Partially Hedged), thesaurierend (Auflegung: 05. Mrz. 2012)	3,99 %	3,43 %
PIMCO Global Advantage Bond Index (GLADI) (NOK, Partially Hedged) (London Close)	4,37 %	3,02 %

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

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

Anlageziel und Überblick über die Strategie

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

Kommentare zum Fonds

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

» Die Untergewichtung des Engagements in US-Duration trug zur relativen Wertentwicklung bei, da die Zinsen stiegen.

» Die Übergewichtung des Engagements in vorrangigen Finanztiteln war der Wertentwicklung zuträglich, da sich die Spreads verengten.

» Das ausgewählte Engagement in Auslandsschulden von Schwellenländern trug zur relativen Wertentwicklung bei, da sich die Spreads verengten.

» Die Untergewichtung des Engagements in europäischen Peripherieländern, insbesondere italienischen Staatsanleihen, schmälerte die relative Wertentwicklung, da sich die Spreads gegenüber deutschen Bundesanleihen verengten.

» Eine Untergewichtung von Unternehmensanleihen mit Investment Grade außerhalb des Finanzsektors schmälerte die relative Wertentwicklung, da sich die Spreads verengten.

» Die Übergewichtung des Engagements in britischer Duration schmälerte die relative Wertentwicklung, da die Zinsen anstiegen.

Gesamtrendite, ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2023 abgelaufenen Berichtszeitraum[1]

	6 Monate	Auflegung von Klassen
Auf USD lautende Klassen		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 12. Mrz. 1998)	2,97 %	4,78 %
Institutional, ausschüttend (Auflegung: 18. Apr. 2001)	2,94 %	4,44 %
Investor, thesaurierend (Auflegung: 01. Mrz. 1999)	2,78 %	4,26 %
Investor, ausschüttend (Auflegung: 23. Jan. 2001)	2,78 %	4,08 %
Administrative, thesaurierend (Auflegung: 14. Jun. 2004)	2,68 %	3,74 %
Class E, thesaurierend (Auflegung: 31. Mrz. 2006)	2,50 %	3,21 %
Class E, ausschüttend (Auflegung: 28. Okt. 2005)	2,49 %	3,17 %
H Institutional, thesaurierend (Auflegung: 15. Okt. 2002)	2,87 %	4,10 %
H Institutional, ausschüttend (Auflegung: 14. Feb. 2020)	2,78 %	(1,67 %)
M Retail, ausschüttend II (Auflegung: 26. Apr. 2017)	2,49 %	0,52 %
Class T, thesaurierend (Auflegung: 16. Okt. 2014)	2,26 %	0,96 %
Class T, ausschüttend (Auflegung: 16. Okt. 2014)	2,32 %	0,97 %
Class W, thesaurierend (Auflegung 12. Aug. 2020)	3,01 %	(2,71 %)
Class W, ausschüttend (Auflegung 12. Aug. 2020)	2,94 %	(2,75 %)
W Class Income II (Auflegung: 23. Feb. 2023)	—	1,50 %
Bloomberg Global Aggregate (USD Hedged) Index[3]	2,96 %	4,06 %[2]
Auf USD lautende Klassen (Währungsrisiko)		
Institutional (Currency Exposure), thesaurierend (Auflegung 13. Dez. 2002)	1,45 %	3,64 %
Institutional (Currency Exposure), ausschüttend (Auflegung 23. Mär. 2006)	1,41 %	3,19 %
Class E (Currency Exposure), thesaurierend (Auflegung 19. Mai 2010)	1,04 %	1,20 %
Class E (Currency Exposure), ausschüttend (Auflegung 19. Mai 2010)	0,98 %	1,20 %
H Institutional (Currency Exposure), thesaurierend (Auflegung 26. Feb. 2021)	1,35 %	(7,75 %)
Bloomberg Global Aggregate (USD Unhedged) Index[3]	1,43 %	2,82 %[2]
Auf CAD lautende Klassen		
Institutional CAD (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 21. Sep. 2018)	2,57 %	0,76 %
Bloomberg Global Aggregate (CAD Hedged) Index[3]	2,64 %	0,60 %
Auf CHF lautende Klassen		
Institutional CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 08. Mai 2003)	0,80 %	2,24 %
Institutional CHF (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 10. Apr. 2003)	0,79 %	2,28 %
Investor CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 28. Jun. 2011)	0,61 %	1,24 %
E Class CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 13. Jun. 2018)	0,34 %	(2,20 %)
Class W CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung 12. Aug. 2020)	0,93 %	(4,79 %)
Class W CHF (Hedged), ausschüttend (Auflegung 12. Aug. 2020)	0,83 %	(4,82 %)
Bloomberg Global Aggregate (CHF Hedged) Index[3]	0,75 %	1,46 %[2]
Auf EUR lautende Klassen		
Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 04. Apr. 2003)	1,71 %	3,22 %
Institutional EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 12. Apr. 2005)	1,72 %	3,05 %
Investor EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 02. Feb. 2005)	1,52 %	2,70 %
Class E EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 31. Mrz. 2006)	1,25 %	2,24 %
Class E EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 29. Jan. 2016)	1,26 %	(0,87 %)
G Retail EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 12. Dez. 2012)	1,26 %	0,02 %
Class R EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 30. Nov. 2012)	1,52 %	0,65 %
Class T EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 30. Sep. 2014)	1,08 %	(0,72 %)
Class W EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung 12. Aug. 2020)	1,73 %	(4,26 %)
Class W EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung 12. Aug. 2020)	1,66 %	(4,26 %)
Bloomberg Global Aggregate (EUR Hedged) Index[3]	1,66 %	2,37 %[2]

Anlageziel und Überblick über die Strategie

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

Kommentare zum Fonds

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

» Die Untergewichtung des Engagements im vorderen Bereich der US-Renditekurve trug zur relativen Wertentwicklung bei, da die Zinssätze anstiegen.

» Die Übergewichtung des Engagements in vorrangigen Finanztiteln war der Wertentwicklung zuträglich, da sich die Spreads verengten.

» Das Long-Engagement in verbrieften Krediten, insbesondere in hypothekenbesicherten US-Wertpapieren ohne Agency-Schuldtitel, Residential Mortgage-Backed Securitys und europäische besicherte Hypothekenverpflichtungen, trug zur relativen Wertentwicklung bei, da sich die Spreads verengten.

» Die Untergewichtung des Engagements in japanischer Duration schmälerte die relative Wertentwicklung, da die Zinsen einen Abstieg verzeichneten.

» Das taktische Engagement in den japanischen Yen schmälerte die relative Wertentwicklung, da die Währung gegenüber dem US-Dollar an Wert verlor.

» Die Übergewichtung des Engagements in britischer Duration schmälerte die relative Wertentwicklung, da die Zinsen anstiegen.

Gesamtrendite nach Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2023 abgelaufenen Berichtszeitraum[1] (Forts.)	6 Monate	Auflegung von Klassen
Auf EUR lautende Klassen (Währungsrisiko)		
Institutional EUR (Currency Exposure), thesaurierend (Auflegung: 20. Feb. 2013)	(0,70 %)	2,38 %
Bloomberg Global Aggregate (EUR Unhedged) Index[3]	(0,78 %)	1,89 %
Auf GBP lautende Klassen		
Institutional GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 16. Apr. 2003)	2,47 %	4,21 %
Institutional GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 01. Jun. 2004)	2,48 %	4,20 %
Investor GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 14. Apr. 2005)	2,32 %	3,56 %
Class W GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung 12. Aug. 2020)	2,48 %	(3,26 %)
Class W GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung 12. Aug. 2020)	2,58 %	(3,24 %)
Bloomberg Global Aggregate (GBP Hedged) Index[3]	2,43 %	3,41 %[2]
Auf GBP lautende Klassen (Währungsrisiko)		
Institutional GBP (Currency Exposure), thesaurierend (Auflegung: 09. Mrz. 2018)	(4,03 %)	0,45 %
Bloomberg Global Aggregate (GBP Unhedged) Index[3]	(4,03 %)	0,23 %
Auf HKD lautende Klassen		
M Retail HKD (Unhedged), ausschüttend II (Auflegung: 26. Apr. 2017)	2,94 %	0,63 %
Bloomberg Global Aggregate (HKD Unhedged) Index[3]	3,38 %	1,22 %
Auf NOK lautende Klassen		
Institutional NOK (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 30. Jun. 2005)	1,91 %	4,18 %
Investor NOK (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 26. Jul. 2006)	1,74 %	4,14 %
W Class NOK (Hedged), thesaurierend (Auflegung 13. Apr. 2021)	1,96 %	(4,64 %)
Bloomberg Global Aggregate (NOK Hedged) Index[3]	2,02 %	3,33 %[2]
Auf NZD lautende Klassen		
Institutional NZD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 01. Nov. 2004)	2,73 %	6,08 %
Bloomberg Global Aggregate (NZD Hedged) Index[3]	2,73 %	5,20 %
Auf SEK lautende Klassen		
Institutional SEK (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 08. Nov. 2004)	1,81 %	3,37 %
Administrative SEK (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 02. Jul. 2021)	1,56 %	(6,55 %)
Bloomberg Global Aggregate (SEK Hedged) Index[3]	1,88 %	2,46 %[2]
Auf SGD lautende Klassen		
Institutional SGD (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 07. Aug. 2009)	2,33 %	4,13 %
Institutional SGD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 23. Feb. 2023)	—	1,05 %
M Retail SGD (Hedged), ausschüttend II (Auflegung: 23. Feb. 2023)	—	0,70 %
W Class SGD (Hedged), ausschüttend II (Auflegung: 23. Feb. 2023)	—	1,12 %
Bloomberg Global Aggregate (SGD Hedged) Index[3]	2,32 %	2,68 %[2]

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

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

3 *Die Wertentwicklung des Vergleichsindex für den Global Bond Fund repräsentiert Folgendes: Auflegung bis 30. November 2000: JPMorgan GBI Global Index Hedged in USD; ab 01. Dezember 2000: Bloomberg Global Aggregate (USD Hedged) Index*

Gesamtrendite, ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2023 abgelaufenen Berichtszeitraum[1]

	6 Monate	Auflegung von Klassen
Auf USD lautende Klassen		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 12. Jan. 2017)	2,64 %	1,30 %
Institutional, ausschüttend (Auflegung 03. Apr. 2020)	2,63 %	(1,14 %)
Investor, thesaurierend (Auflegung: 07. Nov. 2018)	2,48 %	0,74 %
Class E, ausschüttend (Auflegung: 08. Mrz. 2019)	2,11 %	(0,43 %)
Bloomberg Global Aggregate (USD Hedged) Index	2,96 %	1,17 %[2]
Auf AUD lautende Klassen		
Class Z AUD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 12. Jan. 2017)	2,07 %	1,33 %
Bloomberg Global Aggregate Index (AUD Hedged)	2,07 %	0,68 %
Auf CHF lautende Klassen		
Institutional CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 12. Jan. 2017)	0,44 %	(1,25 %)
E Class CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 01. Sept. 2022)	0,10 %	(3,30 %)
Bloomberg Global Aggregate (CHF Hedged) Index	0,75 %	(1,41 %)[2]
Auf EUR lautende Klassen		
Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 12. Jan. 2017)	1,28 %	(0,76 %)
Institutional EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 12. Jan. 2017)	1,32 %	(0,76 %)
Class E EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung 09. Feb. 2017)	1,01 %	(1,62 %)
Bloomberg Global Aggregate (EUR Hedged) Index	1,66 %	(0,89 %)[2]
Auf EUR lautende Klassen (Währungsrisiko)		
Institutional EUR (Currency Exposure), thesaurierend (Auflegung: 29. Nov. 2021)	(1,02 %)	(8,02 %)
Bloomberg Global Aggregate (EUR Unhedged) Index	(0,78 %)	(7,87 %)
Auf GBP lautende Klassen		
Institutional GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung 03. Jun. 2020)	2,10 %	(2,61 %)
Institutional GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 12. Jan. 2017)	2,18 %	0,27 %
Bloomberg Global Aggregate (GBP Hedged) Index	2,43 %	0,14 %[2]
Auf GBP lautende Klassen (Währungsrisiko)		
Institutional GBP (Currency Exposure), thesaurierend (Auflegung: 04. Aug. 2022)	(4,36 %)	(8,18 %)
Bloomberg Global Aggregate (GBP Unhedged) Index	(4,03 %)	(8,10 %)
Auf GBP lautende Klassen (nicht abgesichert)		
Institutional GBP (Unhedged), ausschüttend (Auflegung 11. Dez. 2020)	(2,88 %)	(2,71 %)
Bloomberg Global Aggregate (GBP Unhedged) Index	(2,58 %)	(1,99 %)
Auf NOK lautende Klassen		
Institutional NOK (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 12. Jan. 2017)	1,58 %	0,41 %
Bloomberg Global Aggregate (NOK Hedged) Index	2,02 %	0,35 %
Auf NZD lautende Klassen		
Institutional NZD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 05. Apr. 2017)	2,45 %	1,03 %
Bloomberg Global Aggregate (NZD Hedged) Index	2,73 %	1,00 %
Auf SEK lautende Klassen		
Institutional SEK (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 20. Mai 2021)	1,51 %	(5,73 %)
Administrative SEK (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 18. Mai 2023)	—	(0,19 %)
Bloomberg Global Aggregate (SEK Hedged) Index	1,88 %	(5,19 %)[2]

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

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

Anlageziel und Überblick über die Strategie

Der Global Bond ESG ist bestrebt, bei gleichzeitigem Kapitalerhalt, einer umsichtigen Anlageverwaltung und nachhaltigen Anlagen (durch die explizite Einbindung von Umwelt-, Sozial- und Unternehmungsführungsfaktoren in den Anlageprozess, wie in der Ergänzung näher dargelegt) die maximal mögliche Rendite zu erzielen. Der Fonds versucht, sein Anlageziel zu erreichen, indem er mindestens zwei Drittel seines Vermögens in ein diversifiziertes Portfolio aus festverzinslichen Wertpapieren (wie im Verkaufsprospekt definiert) anlegt, die auf führende Weltwährungen lauten.

Kommentare zum Fonds

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

» Die Untergewichtung des Engagements im vorderen Bereich der US-Kurve trug zur relativen Wertentwicklung bei, da die Zinssätze anstiegen.

» Die Übergewichtung des Engagements in vorrangigen Finanztiteln war der Wertentwicklung zuträglich, da sich die Spreads verengten.

» Die Positionierung auf der Kurve innerhalb der Eurozone, nämlich eine Untergewichtung im vorderen Bereich, wo die Zinssätze anstiegen, und eine Übergewichtung im 10-jährigen Bereich, wo die Zinssätze fielen, trugen zur relativen Wertentwicklung bei.

» Die Untergewichtung des Engagements in japanischer Duration schmälerte die relative Wertentwicklung, da die Zinsen einen Abstieg verzeichneten.

» Die Untergewichtung des Engagements in chinesischer Duration schmälerte die relative Wertentwicklung, da die Zinsen einen Abstieg verzeichneten.

» Das taktische Engagement in den japanischen Yen schmälerte die relative Wertentwicklung, da die Währung gegenüber dem US-Dollar an Wert verlor.

Gesamtrendite, ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2023 abgelaufenen Berichtszeitraum[1]

	6 Monate	Auflegung von Klassen
Auf USD lautende Klassen		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 31. Mrz. 2003)	3,49 %	4,23 %
Institutional, ausschüttend (Auflegung: 09. Nov. 2005)	3,46 %	4,27 %
Investor, thesaurierend (Auflegung: 28. Feb. 2006)	3,32 %	3,86 %
Administrative, thesaurierend (Auflegung: 14. Sep. 2004)	3,23 %	3,86 %
Class E, ausschüttend (Auflegung: 30. Apr. 2008)	3,07 %	3,37 %
H Institutional, thesaurierend (Auflegung: 12. Dez. 2018)	3,38 %	0,87 %
Class Z, thesaurierend (Auflegung: 30. Okt. 2019)	3,77 %	(0,22 %)
Bloomberg Global Aggregate ex-USD (USD Hedged) Index[3]	3,61 %	3,34 %[2]
Auf USD lautende Klassen (Währungsrisiko)		
Class E (Currency Exposure), ausschüttend (Auflegung 04. Okt. 2016)	0,31 %	(2,47 %)
Bloomberg Global Aggregate ex-USD (USD Unhedged) Index[3]	0,83 %	(2,12 %)
Auf EUR lautende Klassen		
Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 04. Apr. 2006)	2,31 %	3,45 %
Bloomberg Global Aggregate ex-USD (EUR Hedged) Index[3]	2,36 %	2,35 %

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

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

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

Anlageziel und Überblick über die Strategie

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

Kommentare zum Fonds

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

» Die Untergewichtung des Engagements in US-Duration trug zur relativen Wertentwicklung bei, da die Zinsen stiegen.

» Die Übergewichtung des Engagements in vorrangigen Finanztiteln war der Wertentwicklung zuträglich, da sich die Spreads verengten.

» Das Long-Engagement in verbrieften Krediten, insbesondere in Collateralized US-Loan Obligations sowie US-amerikanische und britischen Residential Mortgage-Backed Securitys ohne Agency-Schuldtitel, trug zur relativen Wertentwicklung bei, da sich die Spreads verengten.

» Eine Untergewichtung von Unternehmensanleihen mit Investment Grade außerhalb des Finanzsektors schmälerte die relative Wertentwicklung, da sich die Spreads verengten.

» Das taktische Engagement in den japanischen Yen schmälerte die relative Wertentwicklung, da die Währung gegenüber dem US-Dollar an Wert verlor.

» Die Übergewichtung des Engagements in britischer Duration schmälerte die relative Wertentwicklung, da die Zinsen anstiegen.

Gesamtrendite, ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2023 abgelaufenen Berichtszeitraum[1]

	6 Monate	Auflegung von Klassen
Auf USD lautende Klassen		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 15. Apr. 2009)	6,23 %	5,35 %
Investor, thesaurierend (Auflegung: 24. Sep. 2010)	6,08 %	3,50 %
Class E, thesaurierend (Auflegung 22. Jun. 2009)	5,60 %	3,86 %
Class E, ausschüttend (Auflegung: 28. Jan. 2011)	5,64 %	2,40 %
H Institutional, thesaurierend (Auflegung: 29. Apr. 2022)	6,15 %	0,09 %
H Institutional, ausschüttend (Auflegung: 29. Apr. 2022)	6,12 %	0,08 %
Class Z, thesaurierend (Auflegung: 06. Jul. 2016)	6,73 %	6,68 %
60 % MSCI All Country World Index/40 % Bloomberg Global Aggregate USD Hedged	9,49 %	7,68 %[2]
Auf EUR lautende Klassen		
Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 15. Apr. 2009)	5,22 %	4,44 %
Class E EUR (Hedged), thesaurierende Anteile (Auflegung: 22. Jun. 2009)	4,54 %	2,95 %
Class E EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung 24. Jun. 2011)	4,65 %	1,36 %
60 % MSCI All Country World Index EUR Hedged/40 % Bloomberg Global Aggregate EUR Hedged	8,34 %	6,57 %[2]
Auf GBP lautende Klassen		
Institutional GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 07. Apr. 2010)	6,10 %	3,72 %
60 % MSCI All Country World Index GBP Hedged/40 % Bloomberg Global Aggregate GBP Hedged	9,08 %	5,94 %

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

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

Anlageziel und Überblick über die Strategie

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

Kommentare zum Fonds

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

» Das Engagement in ausgewählten Schwellenmarktwährungen, insbesondere die Übergewichtung des Engagements im brasilianischen Real und mexikanischen Peso sowie die Untergewichtung des Engagements im chinesischen Yuan trugen zur relativen Wertentwicklung bei, da der brasilianische Real und der mexikanische Peso gegenüber dem US-Dollar an Wert gewannen, der chinesische Yuan gegenüber dem US-Dollar dagegen an Wert verlor.

» Das Engagement in hochverzinslichen Unternehmensanleihen und solchen mit Investment Grade, insbesondere die Übergewichtung und die Titelauswahl bei Finanzwerten, trug zur relativen Wertentwicklung bei, da diese Wertpapiere im Berichtszeitraum positive Renditen verzeichneten.

» Die Untergewichtung des Engagements in US-Aktien schmälerte die relative Wertentwicklung, da die US-Aktien im Berichtszeitraum positive Renditen verzeichneten.

» Das Engagement in Schwellenmarktaktien, insbesondere eine ausgewählte Positionierung in der Kategorie zyklische Konsumgüter in chinesischen Aktien, schmälerte die Wertentwicklung, da diese Wertpapiere negative Renditen verzeichneten.

» Die Untergewichtung des Engagements in Aktien der Eurozone schmälerte die relative Wertentwicklung, da die Aktien der Eurozone im Berichtszeitraum positive Renditen verzeichneten.

Gesamtrendite, ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2023 abgelaufenen Berichtszeitraum[1]

	6 Monate	Auflegung von Klassen
Auf USD lautende Klassen		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 30. Jun. 2005)	4,70 %	5,71 %
Institutional, ausschüttend (Auflegung: 30. Dez. 2005)	4,79 %	5,71 %
Investor, thesaurierend (Auflegung: 22. Jun. 2016)	4,51 %	3,51 %
Administrative, thesaurierend (Auflegung: 27. Jun. 2008)	4,43 %	5,21 %
Administrative, ausschüttend (Auflegung: 11. Dez. 2015)	4,47 %	3,96 %
BM Retail, ausschüttend II (Auflegung: 28. Apr. 2022)	3,74 %	(0,23 %)
Class E, thesaurierend (Auflegung: 11. Sep. 2006)	4,24 %	4,67 %
Class E, ausschüttend (Auflegung: 31. Jul. 2006)	4,25 %	4,74 %
H Institutional, thesaurierend (Auflegung: 29. Aug. 2008)	4,66 %	5,67 %
H Institutional, ausschüttend (Auflegung: 22. Mrz. 2013)	4,62 %	3,68 %
M Retail, ausschüttend (Auflegung: 30. Nov. 2010)	4,18 %	4,06 %
M Retail, ausschüttend II (Auflegung: 23. Dez. 2013)	4,35 %	2,81 %
Class R, thesaurierend (Auflegung: 30. Nov. 2012)	4,63 %	3,84 %
Class T, thesaurierend (Auflegung: 16. Okt. 2014)	4,02 %	2,51 %
Class T, ausschüttend (Auflegung: 16. Okt. 2014)	4,08 %	2,51 %
ICE BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index Hedged into USD[3]	5,10 %	6,06 %[2]
Auf CHF lautende Klassen		
Institutional CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 16. Feb. 2010)	2,58 %	3,74 %
Institutional CHF (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 31. Aug. 2012)	2,43 %	2,32 %
ICE BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index Hedged into CHF[3]	2,84 %	4,11 %[2]
Auf EUR lautende Klassen		
Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 02. Mai 2008)	3,42 %	4,29 %
Institutional EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Dez. 2005)	3,40 %	4,55 %
Investor EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 05. Jan. 2011)	3,24 %	3,07 %
Class E EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 31. Mrz. 2006)	2,97 %	3,53 %
Class E EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 29. Apr. 2016)	3,00 %	0,84 %
ICE BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index Hedged into EUR[3]	3,76 %	4,72 %[2]
Auf GBP lautende Klassen		
Institutional GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 25. Mai 2012)	4,21 %	3,92 %
Institutional GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Dez. 2005)	4,14 %	5,28 %
Class E GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 15. Jun. 2009)	3,76 %	5,09 %
ICE BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index Hedged into GBP[3]	4,50 %	5,47 %[2]
Auf SGD lautende Klassen		
Class E SGD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 25. Apr. 2016)	3,61 %	2,59 %
ICE BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index Hedged into SGD[3]	4,45 %	3,97 %

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

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

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

Anlageziel und Überblick über die Strategie

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

Kommentare zum Fonds

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

» Die Übergewichtung und die Titelauswahl in den Sektoren Glücksspiel und Hotellerie trugen zur Wertentwicklung bei, da die Sektoren den Gesamtmarkt aufgrund der starken Verbrauchernachfrage nach Freizeit- und Unterhaltungsdienstleistungen übertrafen.

» Die Titelauswahl im Sektor nicht zyklische Konsumgüter trug zur Wertentwicklung bei, da sich die Übergewichtung eines ausgewählten Emittenten unterdurchschnittlich entwickelte.

» Die Titelauswahl in den Sektoren Finanzen und Versicherungen war der Wertentwicklung abträglich, da sich das Engagement in nachrangigen Schuldtiteln und insbesondere in einer ausgewählten Schweizer Bank unterdurchschnittlich entwickelte.

» Die Übergewichtung und die Titelauswahl in den Chemiewerten beeinträchtigten die Wertentwicklung, da der Sektor hinter dem Gesamtmarkt zurückblieb, während die Übergewichtung eines ausgewählten Emittenten eine Underperformance aufwies.

» Die Titelauswahl in den Sektoren Medien, Unterhaltung und Verlagswesen war der Wertentwicklung abträglich, da die Übergewichtung ausgewählter Emittenten hinter den Erwartungen zurückblieb.

Gesamtrendite, ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2023 abgelaufenen Berichtszeitraum[1]

	6 Monate	Auflegung von Klassen
Auf USD lautende Klassen		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 18. Apr. 2008)	3,44 %	4,12 %
Institutional, ausschüttend (Auflegung: 23. Jul. 2003)	3,38 %	4,34 %
Investor, thesaurierend (Auflegung: 15. Feb. 2005)	3,25 %	3,72 %
Investor, ausschüttend (Auflegung: 22. Jan. 2009)	3,19 %	4,36 %
Administrative, thesaurierend (Auflegung: 21. Jan. 2009)	3,17 %	4,20 %
Administrative, ausschüttend (Auflegung: 21. Jan. 2009)	3,07 %	4,20 %
Class E, thesaurierend (Auflegung: 10. Dez. 2008)	2,99 %	3,98 %
Class E, ausschüttend (Auflegung: 30. Apr. 2008)	2,96 %	3,13 %
H Institutional, thesaurierend (Auflegung: 29. Aug. 2008)	3,36 %	4,08 %
H Institutional, ausschüttend (Auflegung: 25. Mai 2018)	3,35 %	0,47 %
M Retail, ausschüttend (Auflegung: 28. Sep. 2012)	2,96 %	1,40 %
M Retail, ausschüttend II (Auflegung: 23. Dez. 2013)	2,95 %	1,53 %
Class R, thesaurierend (Auflegung: 30. Nov. 2012)	3,30 %	1,90 %
Class R, ausschüttend (Auflegung: 30. Nov. 2012)	3,28 %	1,91 %
Class T, thesaurierend (Auflegung: 16. Okt. 2014)	2,73 %	0,61 %
Class W, thesaurierend (Auflegung 12. Aug. 2020)	3,48 %	(3,93 %)
Class W, ausschüttend (Auflegung 12. Aug. 2020)	3,37 %	(3,92 %)
Bloomberg Global Aggregate Credit Index (USD Hedged)	3,00 %	3,65 %[2]
Auf USD lautende Klassen (Währungsrisiko)		
Institutional (Currency Exposure), thesaurierend (Auflegung 02. Aug. 2013)	3,91 %	1,27 %
Institutional (Currency Exposure), ausschüttend (Auflegung 06. Sep. 2016)	3,85 %	0,09 %
H Institutional (Currency Exposure), thesaurierend (Auflegung 26. Feb. 2021)	3,72 %	(7,37 %)
Bloomberg Global Aggregate Credit Index (USD Unhedged)	3,42 %	1,20 %[2]
Auf AUD lautende Klassen		
Institutional AUD (Hedged), ausschüttend (Auflegung 07. Apr. 2020)	2,53 %	(1,61 %)
Investor AUD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 25. Jun. 2018)	2,36 %	(0,54 %)
Bloomberg Global Aggregate Credit Index (AUD Hedged)	2,03 %	0,35 %[2]
Auf CHF lautende Klassen		
Institutional CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 10. Dez. 2009)	1,22 %	1,90 %
Institutional CHF (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 06. Feb. 2015)	1,24 %	(0,72 %)
Investor CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 10. Mai 2011)	1,01 %	0,75 %
Investor CHF (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 22. Jan. 2009)	0,94 %	2,67 %
Administrative CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 31. Jan. 2013)	0,94 %	(0,36 %)
Class E CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 06. Mrz. 2012)	0,81 %	(0,06 %)
Class W CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung 12. Aug. 2020)	1,21 %	(6,03 %)
Bloomberg Global Aggregate Credit Index (CHF Hedged)	0,74 %	2,27 %[2]
Auf CZK lautende Klassen		
Institutional CZK (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 19. Mai 2015)	4,26 %	1,14 %
Bloomberg Global Aggregate Credit Index (CZK Hedged)	3,81 %	1,33 %
Auf EUR lautende Klassen		
Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 15. Sep. 2003)	2,08 %	3,37 %
Institutional EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 15. Sep. 2008)	2,09 %	3,27 %
Investor EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 08. Mai 2006)	1,96 %	2,83 %
Investor EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 22. Jan. 2009)	2,00 %	3,25 %
Administrative EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 17. Feb. 2009)	1,87 %	2,98 %
Administrative EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 17. Feb. 2009)	1,94 %	2,98 %
Class E EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 31. Mrz. 2006)	1,66 %	2,22 %
Class E EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 09. Sep. 2010)	1,71 %	0,99 %

Anlageziel und Überblick über die Strategie

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

Kommentare zum Fonds

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

» Makrostrategien und insbesondere die Durationspositionierung in Industrieländern begünstigten die Wertentwicklung.

» Die Übergewichtung und die Titelauswahl im Sektor Transport trugen zur Wertentwicklung bei, da die Übergewichtung ausgewählter Emittenten aufgrund einer anhaltenden Zunahme der Reiseaktivitäten eine Outperformance erzielte.

» Die Titelauswahl in Finanzgesellschaften trug zur Wertentwicklung bei, da sich die Übergewichtung ausgewählter Emittenten gegenüber dem Gesamtmarkt überdurchschnittlich entwickelte.

» Die Titelauswahl im Sektor Bankwesen war der Wertentwicklung abträglich, da sich das Engagement in nachrangigen Schuldtiteln und insbesondere in einer ausgewählten Schweizer Bank unterdurchschnittlich entwickelte.

» Die Titelauswahl in den Auslandsschulden von Schwellenländern war der Wertentwicklung abträglich, da ausgewählte alte russische Positionen zurückblieben.

Gesamtrendite nach Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2023 abgelaufenen Berichtszeitraum[1] (Forts.)	6 Monate	Auflegung von Klassen
Class R EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Nov. 2012)	1,93 %	0,35 %
Class T EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 30. Sep. 2014)	1,46 %	(1,13 %)
Class W EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung 12. Aug. 2020)	2,17 %	(5,52 %)
Class W EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung 12. Aug. 2020)	2,11 %	(5,52 %)
Bloomberg Global Aggregate Credit Index (EUR Hedged)	1,64 %	2,65 %[2]
Auf EUR lautende Klassen (Währungsrisiko)		
Institutional EUR (Currency Exposure), thesaurierend (Auflegung: 16. Aug. 2012)	1,65 %	2,38 %
Class E EUR (Currency Exposure), ausschüttend (Auflegung: 12. Dez. 2018)	1,22 %	(0,08 %)
Bloomberg Global Aggregate Credit Index (EUR Unhedged)	1,17 %	2,50 %[2]
Auf GBP lautende Klassen		
Institutional GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 02. Sep. 2005)	2,88 %	3,75 %
Institutional GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 11. Jul. 2008)	2,86 %	3,88 %
Investor GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 22. Jan. 2009)	2,70 %	3,89 %
Administrative GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Jan. 2009)	2,63 %	3,71 %
Class E GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 31. Mrz. 2009)	2,47 %	3,39 %
Class R GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Nov. 2012)	2,76 %	1,22 %
Class W GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung 12. Aug. 2020)	2,94 %	(4,53 %)
Class W GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung 12. Aug. 2020)	2,85 %	(4,51 %)
Bloomberg Global Aggregate Credit Index (GBP Hedged)	2,42 %	3,18 %[2]
Auf HKD lautende Klassen		
Administrative HKD (Unhedged), ausschüttend (Auflegung: 28. Jul. 2017)	3,58 %	0,14 %
M Retail HKD (Unhedged), ausschüttend (Auflegung: 28. Jul. 2017)	3,37 %	(0,24 %)
Bloomberg Global Aggregate Credit Index (USD Hedged) Index, lautend auf HKD	3,41 %	1,17 %
Auf NOK lautende Klassen		
Institutional NOK (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 18. Jan. 2012)	2,38 %	2,78 %
Bloomberg Global Aggregate Credit Index (NOK Hedged)	2,01 %	2,59 %
Auf SEK lautende Klassen		
Institutional SEK (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 04. Dez. 2009)	2,30 %	2,87 %
Administrative SEK (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 13. Dez. 2012)	1,97 %	0,33 %
Bloomberg Global Aggregate Credit Index (SEK Hedged)	1,89 %	2,45 %[2]
Auf SGD lautende Klassen		
Institutional SGD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Okt. 2015)	2,73 %	1,58 %
Investor SGD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 23. Mai 2018)	2,57 %	(0,11 %)
Administrative SGD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 22. Sept. 2017)	2,53 %	(0,52 %)
Class E SGD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 18. Jul. 2012)	2,38 %	1,35 %
Class W SGD (Hedged), ausschüttend (Auflegung 13. Okt. 2020)	2,75 %	(4,65 %)
Bloomberg Global Aggregate Credit Index (SGD Hedged)	2,31 %	2,19 %[2]

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

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

Gesamtrendite, ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2023 abgelaufenen Berichtszeitraum[1]

	6 Monate	Auflegung von Klassen
Auf USD lautende Klassen		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 28. Sep. 2018)	2,59 %	1,39 %
Institutional, ausschüttend (Auflegung: 19. Jul. 2019)	2,59 %	(0,68 %)
Investor, thesaurierend (Auflegung: 04. Mai 2021)	2,45 %	(5,86 %)
Class E, thesaurierend (Auflegung: 28. Feb. 2020)	2,19 %	(3,53 %)
Class E, ausschüttend (Auflegung: 28. Feb. 2020)	2,17 %	(3,53 %)
Class Z, thesaurierend (Auflegung: 20. Jun. 2019)	2,88 %	0,05 %
Bloomberg Global Aggregate Credit Index (USD Hedged)	3,00 %	1,21 %[2]
Auf CHF lautende Klassen		
Institutional CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 28. Sep. 2018)	0,43 %	(1,21 %)
Institutional CHF (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 28. Feb. 2020)	0,42 %	(4,83 %)
Class E CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 28. Feb. 2020)	0,00 %	(5,71 %)
Class E CHF (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 28. Feb. 2020)	(0,04 %)	(5,69 %)
Bloomberg Global Aggregate Credit Index (CHF Hedged)	0,74 %	(1,42 %)[2]
Auf EUR lautende Klassen		
Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 28. Sep. 2018)	1,36 %	(0,68 %)
Institutional EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 28. Feb. 2020)	1,43 %	(4,29 %)
Investor EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 05. Jan. 2023)	—	0,50 %
Investor EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 05. Jan. 2023)	—	0,44 %
Class E EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 28. Feb. 2020)	0,96 %	(5,16 %)
Class E EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 28. Feb. 2020)	0,85 %	(5,19 %)
Bloomberg Global Aggregate Credit Index (EUR Hedged)	1,64 %	(0,89 %)[2]
Auf GBP lautende Klassen		
Institutional GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 28. Sep. 2018)	2,11 %	0,29 %
Institutional GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 1. Mai 2019)	2,09 %	(0,78 %)
Class E GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 28. Feb. 2020)	1,65 %	(4,32 %)
Bloomberg Global Aggregate Credit Index (GBP Hedged)	2,42 %	0,12 %[2]
Auf SEK lautende Klassen		
Institutional SEK (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 03. Nov. 2022)	1,48 %	5,23 %
Administrative SEK (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 27. Nov. 2019)	1,22 %	(3,47 %)
Bloomberg Global Aggregate Credit Index (SEK Hedged)	1,89 %	(3,03 %)[2]

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

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

Anlageziel und Überblick über die Strategie

Der Global Investment Grade Credit ESG Fund ist bestrebt, bei gleichzeitigem Kapitalerhalt, einer umsichtigen Anlageverwaltung und nachhaltigen Anlagen (durch die explizite Einbindung von Umwelt-, Sozial- und Unternehmungsführungsfaktoren in den Anlageprozess, wie in der Ergänzung näher dargelegt) die maximal mögliche Rendite zu erzielen. Der Fonds beabsichtigt, sein Anlageziel zu erreichen, indem er mindestens zwei Drittel seines Vermögens in ein diversifiziertes Portfolio von Unternehmensanleihen mit Investment Grade (wie im Verkaufsprospekt definiert) anlegt.

Kommentare zum Fonds

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

» Die Titelauswahl in Auslandsschulden von Schwellenländern trug zur Wertentwicklung bei, da sich die Übergewichtung des Engagements in den SGU-Anleihen ausgewählter Staaten, regierungsnaher Unternehmen und Emittenten von Unternehmensanleihen überdurchschnittlich entwickelte.

» Die Titelauswahl im Sektor Automobil trug zur Wertentwicklung bei, da sich das Engagement in SGU-Anleihen ausgewählter Automobilzulieferer überdurchschnittlich entwickelte.

» Makrostrategien und insbesondere die Durations- und Kurvenpositionierung in den USA belasteten die Wertentwicklung.

» Die Titelauswahl im Sektor Bankenwesen war der Wertentwicklung abträglich, da das Engagement in ausgewählten vor- und nachrangigen Anleihen aufgrund der allgemeinen Volatilität im Sektor Bankenwesen eine Underperformance aufwies.

» Die Übergewichtung von Immobilienfonds belastete die Wertentwicklung, da der Sektor aufgrund von Bedenken bzgl. der Auswirkungen höherer Zinssätze und strafferer Finanzbedingungen hinter dem Gesamtmarkt zurückblieb.

Gesamtrendite, ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2023 abgelaufenen Berichtszeitraum[1]

	6 Monate	Auflegung von Klassen
Auf USD lautende Klassen		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 18. Feb. 2014)	1,27 %	1,92 %
Investor, thesaurierend (Auflegung: 05. Okt. 2016)	1,14 %	2,16 %
Class E, thesaurierend (Auflegung: 18. Feb. 2014)	0,83 %	1,00 %
Bloomberg World Government Inflation-Linked Bond 1-5 Year Index (USD Hedged)	1,54 %	1,94 %[2]
Auf CHF lautende Klassen		
Institutional CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 18. Feb. 2014)	(0,81 %)	(0,22 %)
Bloomberg World Government Inflation-Linked Bond 1-5 Year Index (CHF Hedged)	(0,60 %)	(0,26 %)
Auf EUR lautende Klassen		
Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 18. Feb. 2014)	0,10 %	0,27 %
Institutional EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 17. Jan. 2017)	0,08 %	0,41 %
Class E EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 18. Feb. 2014)	(0,32 %)	(0,62 %)
Bloomberg World Government Inflation-Linked Bond 1-5 Year Index (EUR Hedged)	0,32 %	0,30 %[2]
Auf GBP lautende Klassen		
Institutional GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 20. Jan. 2017)	0,83 %	1,46 %
Institutional GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 18. Feb. 2014)	0,80 %	1,20 %
Bloomberg World Government Inflation-Linked Bond 1-5 Year Index (GBP Hedged)	1,07 %	1,22 %[2]
Auf SGD lautende Klassen		
Institutional SGD (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 22. Sep. 2022)	0,70 %	1,30 %
Bloomberg World Government Inflation-Linked Bond 1-5 Year Index (SGD Hedged)	0,97 %	1,03 %

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

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

Anlageziel und Überblick über die Strategie

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

Kommentare zum Fonds

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

» Die Untergewichtung des Engagements in auf Euro lautenden Derivaten, insbesondere Zinsswaps und Optionen, trug zur relativen Wertentwicklung bei, da die Swapsätze stiegen.

» Die Untergewichtung im Engagement bei nominalen US-Staatszinsen begünstigte die relative Wertentwicklung, da die nominalen US-Renditen anstiegen.

» Das Engagement in hypothekenbesicherten Wertpapieren (MBS) mit Agency-Schuldtiteln, insbesondere Residential MBS (RMBS), trug zur relativen Wertentwicklung bei, da sich die RMBS-Spreads verengten.

» Die Untergewichtung im Engagement bei nominalen japanischen Staatszinsen belastete die relative Wertentwicklung, da die nominalen Renditen in Japan zurückgingen.

» Die Kurvenpositionierung in italienischen nominalen Zinssätzen für Staatsanleihen, insbesondere die Untergewichtung des Engagements im 10-jährigen Bereich der Kurve, war der relativen Wertentwicklung abträglich, da der 10-jährige Bereich der Kurve zurückging.

» Die Übergewichtung des Engagements in den japanischen Yen, die durch eine Untergewichtung des US-Dollars finanziert wurde, war der relativen Wertentwicklung abträglich, da der Yen gegenüber dem US-Dollar an Wert verlor.

Gesamtrendite, ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2023 abgelaufenen Berichtszeitraum[1]

	6 Monate	Auflegung von Klassen
Auf USD lautende Klassen		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 30. Sep. 2003)	1,67 %	4,06 %
Institutional, ausschüttend (Auflegung: 30. Dez. 2005)	1,70 %	3,70 %
Investor, thesaurierend (Auflegung: 04. Mrz. 2004)	1,44 %	3,53 %
Investor, ausschüttend (Auflegung: 24. Feb. 2009)	1,51 %	3,95 %
Administrative, thesaurierend (Auflegung: 17. Dez. 2004)	1,42 %	3,27 %
Class E, thesaurierend (Auflegung: 31. Mrz. 2006)	1,19 %	2,92 %
Class E, ausschüttend (Auflegung: 28. Okt. 2005)	1,15 %	2,82 %
H Institutional, thesaurierend (Auflegung: 21. Mai 2004)	1,58 %	3,86 %
Class R, thesaurierend (Auflegung: 30. Nov. 2012)	1,52 %	1,76 %
Bloomberg World Government Inflation-Linked Bond USD Hedged Index	1,72 %	3,85 %[2]
Auf USD lautende Klassen (Währungsrisiko)		
Institutional (Currency Exposure), thesaurierend (Auflegung 01. Sep. 2017)	2,56 %	0,00 %
Bloomberg World Government Inflation-Linked Bond USD Unhedged Index	2,59 %	(0,22 %)
Auf CHF lautende Klassen		
Institutional CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 16. Mai 2008)	(0,53 %)	1,80 %
Institutional CHF (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Okt. 2015)	(0,43 %)	0,04 %
Investor CHF (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 24. Feb. 2009)	(0,66 %)	2,23 %
Bloomberg World Government Inflation-Linked Bond CHF Hedged Index	(0,53 %)	1,49 %[2]
Auf EUR lautende Klassen		
Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 30. Sep. 2003)	0,39 %	3,07 %
Institutional EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Dez. 2005)	0,41 %	2,61 %
Investor EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 07. Apr. 2004)	0,24 %	2,60 %
Class E EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 31. Mrz. 2006)	(0,06 %)	1,86 %
Bloomberg World Government Inflation-Linked Bond EUR Hedged Index	0,36 %	2,82 %[2]
Auf GBP lautende Klassen		
Institutional GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 05. Feb. 2004)	1,19 %	4,01 %
Institutional GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 27. Apr. 2005)	1,11 %	3,57 %
Class R GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 30. Nov. 2012)	0,99 %	1,08 %
Bloomberg World Government Inflation-Linked Bond GBP Hedged Index	1,13 %	3,83 %[2]
Auf SGD lautende Klassen		
Institutional SGD (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 29. Feb. 2008)	1,01 %	3,10 %
Bloomberg World Government Inflation-Linked Bond SGD Hedged Index	1,04 %	2,96 %

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

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

Anlageziel und Überblick über die Strategie

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

Kommentare zum Fonds

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

» Die Untergewichtung im Engagement bei nominalen deutschen Staatszinsen begünstigte die relative Wertentwicklung, da die nominalen deutschen Renditen anstiegen.

» Die Untergewichtung des Engagements in auf Euro lautenden Derivaten, insbesondere Zinsswaps und Optionen, trug zur relativen Wertentwicklung bei, da die Swapsätze stiegen.

» Das Engagement in hypothekenbesicherten Wertpapieren (MBS) mit Agency-Schuldtiteln, insbesondere Residential MBS (RMBS), trug zur relativen Wertentwicklung bei, da sich die RMBS-Spreads verengten.

» Die Untergewichtung im Engagement bei nominalen japanischen Staatszinsen belastete die relative Wertentwicklung, da die nominalen Renditen in Japan zurückgingen.

» Die Kurvenpositionierung in italienischen nominalen Zinssätzen für Staatsanleihen, insbesondere die Untergewichtung des Engagements im 10- und 12-jährigen Bereich der Kurve, war der relativen Wertentwicklung abträglich, da der 10- und 12-jährige Bereich der Kurve zurückging.

» Die Übergewichtung des Engagements in den japanischen Yen, die durch eine Untergewichtung des US-Dollars finanziert wurde, war der relativen Wertentwicklung abträglich, da der Yen gegenüber dem US-Dollar an Wert verlor.

Gesamtrendite, ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2023 abgelaufenen Berichtszeitraum[1]

	6 Monate	Auflegung von Klassen
Auf USD lautende Klassen		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 30. Nov. 2012)	3,29 %	4,74 %
Institutional, ausschüttend (Auflegung: 30. Nov. 2012)	3,26 %	4,74 %
Investor, thesaurierend (Auflegung: 20. Jan. 2015)	3,12 %	3,38 %
Investor, ausschüttend (Auflegung: 18. Apr. 2013)	3,17 %	3,56 %
Administrative, thesaurierend (Auflegung: 13. Feb. 2017)	2,99 %	2,52 %
Administrative, ausschüttend (Auflegung: 30. Nov. 2012)	2,96 %	4,22 %
Class E, thesaurierend (Auflegung: 30. Nov. 2012)	2,84 %	3,81 %
Class E, ausschüttend (Auflegung: 30. Nov. 2012)	2,85 %	3,80 %
H Institutional, thesaurierend (Auflegung: 25. Mai 2018)	3,16 %	2,62 %
H Institutional, ausschüttend (Auflegung: 25. Mai 2018)	3,16 %	2,62 %
Class R, thesaurierend (Auflegung 07. Nov. 2019)	3,14 %	1,37 %
Class R, ausschüttend (Auflegung: 30. Apr. 2015)	3,16 %	3,28 %
Class T, thesaurierend (Auflegung: 16. Okt. 2014)	2,62 %	2,27 %
Class T, ausschüttend (Auflegung: 16. Okt. 2014)	2,57 %	2,28 %
Class Z, thesaurierend (Auflegung: 30. Nov. 2012)	3,60 %	5,31 %
Bloomberg U.S. Aggregate Index	2,09 %	1,18 %[2]
Auf AUD lautende Klassen		
Institutional AUD (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 17. Jan. 2018)	2,36 %	1,49 %
Investor AUD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 23. Mai 2018)	2,14 %	1,45 %
Administrative AUD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 08. Jun. 2016)	2,05 %	2,43 %
Class E AUD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 16. Feb. 2017)	1,86 %	1,39 %
Class Z AUD (Hedged), ausschüttend II (Auflegung: 28. Okt. 2015)	2,56 %	3,80 %
Bloomberg U.S. Aggregate (AUD Hedged) Index	1,13 %	0,71 %[2]
Auf BRL lautende Klassen		
Institutional BRL (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 03. Feb. 2016)	16,56 %	6,53 %
Bloomberg Global Aggregate (BRL Hedged) Index	6,33 %	7,24 %
Auf CAD lautende Klassen		
Institutional CAD (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 01. Apr. 2016)	2,94 %	3,25 %
Institutional CAD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 07. Sep. 2018)	2,94 %	2,42 %
Bloomberg U.S. Aggregate Index (CAD Hedged)	1,74 %	0,31 %[2]
Auf CHF lautende Klassen		
Institutional CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 18. Dez. 2014)	1,08 %	1,35 %
Institutional CHF (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Okt. 2015)	1,03 %	1,07 %
Class E CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 18. Feb. 2014)	0,56 %	0,74 %
Class E CHF (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 18. Feb. 2014)	0,70 %	0,75 %
Bloomberg U.S. Aggregate (CHF Hedged) Index	(0,16 %)	(0,88 %)[2]
Auf CNH lautende Klassen		
Investor RMB (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 03. Jan. 2018)	1,61 %	2,96 %
Class E RMB (Hedged), ausschüttend (Auflegung 22. Mai 2013)	1,34 %	4,60 %
Bloomberg U.S. Aggregate (CNH Hedged) Index	0,46 %	3,23 %[2]
Auf EUR lautende Klassen		
Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 30. Nov. 2012)	1,98 %	3,15 %
Institutional EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Nov. 2012)	1,95 %	3,13 %
Institutional EUR (Hedged), ausschüttend II (Auflegung: 29. Jul. 2014)	1,89 %	1,77 %
Investor EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 10. Apr. 2015)	1,85 %	1,17 %
Investor EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 07. Mai 2015)	1,77 %	1,22 %
Investor EUR (Hedged), ausschüttend A (Auflegung: 16. Dez. 2015)	1,88 %	1,36 %

Anlageziel und Überblick über die Strategie

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

Kommentare zum Fonds

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

» Das Long-Engagement in Schuldtiteln mit Investment Grade und hochverzinslichen Unternehmensanleihen trug zur Wertentwicklung bei, da sich die Spreads verengten.

» Das Long-Engagement bei ausgewählten Währungen von Schwellenländern war der Wertentwicklung zuträglich, da die Währungen gegenüber dem US-Dollar an Wert gewannen.

» Die Auswahl in lokalen Schuldtiteln aus Schwellenländern trug zur Wertentwicklung bei, da der Kurs der zugrunde liegenden Wertpapiere zulegte.

» Das Long-Engagement bei US-Duration schmälerte die Wertentwicklung, da die US-Zinsen anstiegen.

» Das Long-Engagement in den japanischen Yen und die norwegische Krone schmälerte die Wertentwicklung, da die Währungen gegenüber dem US-Dollar nachgaben.

» Das Short-Engagement in japanischer Duration schmälerte die Wertentwicklung, da die japanischen Zinsen einen Abstieg verzeichneten.

Gesamtrendite nach Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2023 abgelaufenen Berichtszeitraum[1] (Forts.)

	6 Monate	Auflegung von Klassen
Administrative EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 14. Aug. 2015)	1,68 %	1,12 %
Administrative EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 08. Jun. 2016)	1,66 %	0,87 %
Class E EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 30. Nov. 2012)	1,45 %	2,22 %
Class E EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Nov. 2012)	1,57 %	2,22 %
Class E EUR (Hedged), ausschüttend II (Auflegung: 31. Aug. 2018)	1,56 %	(0,16 %)
Class E EUR (Hedged), ausschüttend II Q (Auflegung: 30. Sep. 2019)	1,56 %	(1,00 %)
G Retail EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 25. Aug. 2017)	1,55 %	(0,61 %)
Class R EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 29. Jan. 2016)	1,85 %	1,48 %
Class T EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 30. Sep. 2014)	1,36 %	0,45 %
Class T EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Sep. 2014)	1,36 %	0,45 %
Bloomberg U.S. Aggregate (EUR Hedged) Index	0,74 %	(0,33 %)[2]
Auf GBP lautende Klassen		
Institutional GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 07. Feb. 2019)	2,80 %	1,40 %
Institutional GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 15. Feb. 2013)	2,73 %	3,23 %
Investor GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 29. Jan. 2020)	2,60 %	(0,20 %)
Administrative GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 02. Sept. 2016)	2,45 %	1,56 %
Class E GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 15. Mrz. 2017)	2,31 %	0,82 %
Class R GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Nov. 2012)	2,65 %	3,71 %
Bloomberg U.S. Aggregate (GBP Hedged) Index	1,51 %	0,57 %[2]
Auf HKD lautende Klassen		
Institutional HKD (Unhedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Okt. 2015)	3,70 %	3,79 %
Administrative HKD (Unhedged), ausschüttend (Auflegung: 26. Apr. 2017)	3,41 %	2,43 %
Class E HKD (Unhedged), ausschüttend (Auflegung 04. Feb. 2013)	3,30 %	3,20 %
Bloomberg U.S. Aggregate (HKD Unhedged) Index	2,51 %	1,38 %[2]
Auf JPY lautende Klassen		
Institutional JPY (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 10. Mrz. 2023)	—	0,80 %
Investor JPY (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 02. Jun. 2023)	—	0,40 %
Class E JPY (Hedged), thesaurierend (Auflegung 01. Sep. 2017)	0,00 %	(0,70 %)
Class E JPY (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 21. Dez. 2022)	(0,01 %)	(0,81 %)
Bloomberg U.S. Aggregate (JPY Hedged) Index	(0,90 %)	(1,98 %)[2]
Auf NOK lautende Klassen		
Institutional NOK (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 19. Apr. 2017)	2,17 %	1,62 %
Bloomberg U.S. Aggregate (NOK Hedged) Index	1,12 %	(0,28 %)
Auf SGD lautende Klassen		
Institutional SGD (Hedged), thesaurierend (Auflegung 14. Jul. 2020)	2,66 %	1,43 %
Institutional SGD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 16. Dez. 2015)	2,63 %	3,47 %
Investor SGD (Hedged), thesaurierend (Auflegung 07. Feb. 2020)	2,44 %	0,24 %
Investor SGD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 23. Mai 2018)	2,48 %	2,00 %
Administrative SGD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Nov. 2012)	2,34 %	4,01 %
Class E SGD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 19. Feb. 2013)	2,13 %	2,87 %
Bloomberg U.S. Aggregate (SGD Hedged) Index	1,40 %	1,05 %[2]

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

[2] *Die Wertentwicklung des Vergleichsindex seit der Auflegung wird ab dem Auflegungsdatum der ältesten Anteilsklasse berechnet*

Gesamtrendite, ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2023 abgelaufenen Berichtszeitraum[1]

	6 Monate	Auflegung von Klassen
Auf USD lautende Klassen		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 29. Jan. 2021)	2,99 %	(1,42 %)
Institutional, ausschüttend (Auflegung: 03. Mrz. 2023)	—	1,97 %
E Class Income (Auflegung: 29. Jan. 2021)	2,48 %	(2,31 %)
Bloomberg U.S. Aggregate Index	2,09 %	(5,11 %)[2]
Auf AUD lautende Klassen		
E Class AUD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 29. Jan. 2021)	1,56 %	(3,23 %)
Bloomberg U.S. Aggregate (AUD Hedged) Index	1,13 %	(6,10 %)
Auf EUR lautende Klassen		
E Class EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 17. Feb. 2021)	1,09 %	(4,19 %)
Bloomberg U.S. Aggregate (EUR Hedged) Index	0,74 %	(6,77 %)
Auf GBP lautende Klassen		
E Class GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 17. Feb. 2021)	1,91 %	(3,01 %)
Bloomberg U.S. Aggregate (GBP Hedged) Index	1,51 %	(5,70 %)
Auf HKD lautende Klassen		
E Class HKD (Unhedged), ausschüttend (Auflegung: 29. Jan. 2021)	2,84 %	(1,90 %)
Bloomberg U.S. Aggregate (HKD Unhedged) Index	2,51 %	(4,69 %)

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

Anlageziel und Überblick über die Strategie

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

Kommentare zum Fonds

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

» Das Long-Engagement bei ausgewählten Währungen von Schwellenländern war der Wertentwicklung zuträglich, da die Währungen gegenüber dem US-Dollar an Wert gewannen.

» Das Long-Engagement in Schuldtiteln mit Investment Grade und hochverzinslichen Unternehmensanleihen trug zur Wertentwicklung bei, da sich die Spreads verengten.

» Das Long-Engagement in europäischen Residential und Commercial Mortgage Backed Securitys trug zur Wertentwicklung bei, da die Spreads schrumpften.

» Das Long-Engagement in US-Duration schmälerte die Wertentwicklung, da die US-Zinsen anstiegen.

» Das Short-Engagement in japanischer Duration schmälerte die Wertentwicklung, da die japanischen Zinsen einen Anstieg verzeichneten.

» Das taktische Engagement in den japanischen Yen schmälerte die Wertentwicklung, da der japanische Yen gegenüber dem US-Dollar nachgab.

Gesamtrendite, ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2023 abgelaufenen Berichtszeitraum[1]

	6 Monate	Auflegung von Klassen
Auf USD lautende Klassen		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 14. Feb. 2013)	0,54 %	1,09 %
Administrative, ausschüttend II (Auflegung: 22. Mrz. 2022)	0,32 %	(7,06 %)
Class E, thesaurierend (Auflegung: 14. Feb. 2013)	0,10 %	(0,09 %)
E Class, ausschüttend II (Auflegung: 02. Aug. 2022)	0,08 %	(5,56 %)
H Institutional, thesaurierend (Auflegung: 23. Aug. 2022)	0,53 %	(5,00 %)
M Retail, ausschüttend II (Auflegung: 02. Aug. 2022)	0,05 %	(5,61 %)
45 % Bloomberg Global Inflation Linked 1-30yrs Index (USD Hedged), 15 % JPMorgan Emerging Local Markets Index Plus (USD Unhedged), 20 % Bloomberg Commodity Total Return Index, 10 % FTSE NAREIT Global Real Estate Developed Total Return Index (USD Unhedged) und 10 % Bloomberg Gold Subindex Total Return Index-gewichtet (USD Hedged)[3]	0,81 %	1,05 %[2]
Auf AUD lautende Klassen		
E Class AUD (Partially Hedged), thesaurierend (Auflegung: 18. Aug. 2022)	(0,11 %)	(6,60 %)
45 % Bloomberg Global Inflation Linked 1-30yrs Index (AUD Hedged), 15 % JPMorgan Emerging Local Markets Index Plus (AUD Unhedged), 20 % Bloomberg Commodity Total Return Index (AUD Hedged), 10 % FTSE NAREIT Global Real Estate Developed Total Return Index (AUD Unhedged) und 10 % Bloomberg Gold Subindex Total Return Index-gewichtet (AUD Hedged)[3]	0,36 %	(5,01 %)
Auf EUR lautende Klassen		
Institutional EUR (Partially Hedged), thesaurierend (Auflegung: 18. Nov. 2021)	(0,95 %)	(4,08 %)
Class E EUR (Partially Hedged), thesaurierend (Auflegung: 16. Apr. 2013)	(1,40 %)	(0,87 %)
Class E EUR (Partially Hedged), ausschüttend (Auflegung: 16. Apr. 2013)	(1,41 %)	(0,87 %)
45 % Bloomberg Global Inflation Linked 1-30yrs Index (EUR Hedged), 15 % JPMorgan Emerging Local Markets Index Plus (EUR Unhedged), 20 % Bloomberg Commodity Total Return Index (EUR Hedged), 10 % FTSE NAREIT Global Real Estate Developed Total Return Index (EUR Unhedged) und 10 % Bloomberg Gold Subindex Total Return Index-gewichtet (EUR Hedged)[3]	(0,95 %)	0,55 %[2]
Auf GBP lautende Klassen		
Institutional GBP (Partially Hedged), thesaurierend (Auflegung: 30. Mai 2014)	(1,22 %)	1,42 %
E Class GBP (Partially Hedged), thesaurierend (Auflegung: 02. Aug. 2022)	(1,59 %)	(7,40 %)
45 % Bloomberg Global Inflation Linked 1-30yrs Index (GBP Hedged), 15 % JPMorgan Emerging Local Markets Index Plus (GBP Unhedged), 20 % Bloomberg Commodity Total Return Index (GBP Hedged), 10 % FTSE NAREIT Global Real Estate Developed Total Return Index (GBP Unhedged) und 10 % Bloomberg Gold Subindex Total Return Index-gewichtet (GBP Hedged)[3]	(1,20 %)	1,36 %[2]
Auf SGD lautende Klassen		
Administrative SGD (Hedged), ausschüttend II (Auflegung: 22. Feb. 2022)	0,08 %	(4,98 %)
E Class SGD (Partially Hedged), thesaurierend (Auflegung: 02. Aug. 2022)	(0,21 %)	(6,60 %)
45 % Bloomberg Global Inflation Linked 1-30yrs Index (SGD Hedged), 15 % JPMorgan Emerging Local Markets Index Plus (SGD Unhedged), 20 % Bloomberg Commodity Total Return Index (SGD Hedged), 10 % FTSE NAREIT Global Real Estate Developed Total Return Index (SGD Unhedged) und 10 % Bloomberg Gold Subindex Total Return Index-gewichtet (SGD Hedged)[3]	0,38 %	(5,48 %)[2]

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

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

3 *Die Wertentwicklung des Vergleichsindex für den Inflation Multi-Asset Fund repräsentiert Folgendes: Auflegung bis 31. März 2017: 45 % Global Advantage Inflation-Linked Bond Index (USD Partial Hedged), 30 % FTSE NAREIT Global Real Estate Developed REITS Only Index (USD), 15 % Bloomberg Commodity Total Return Index, 10 % Bloomberg Gold Total Return Index; 01. April 2017 bis 12. April 2022: 45 % Bloomberg Global Inflation Linked 1-30yrs Index (USD Hedged), 15 % Bloomberg Emerging Market Government Inflation-Linked Bond Index (USD Unhedged), 10 % Bloomberg Commodity Total Return Index, 10 % FTSE NAREIT Global Real Estate Developed Total Return Index (USD Unhedged), 15 % Alerian MLP Total Return Index, 5 % Bloomberg Gold Subindex Total Return; ab 13. April 2022: 45 % Bloomberg Global Inflation Linked 1-30yrs Index (USD Hedged), 15 % JPMorgan Emerging Local Markets Index Plus (USD Unhedged), 20 % Bloomberg Commodity Total Return Index, 10 % FTSE NAREIT Global Real Estate Developed Total Return Index (USD Unhedged) und 10 % Bloomberg Gold Subindex Total Return Index-gewichtet (USD Hedged)*

Anlageziel und Überblick über die Strategie

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

Kommentare zum Fonds

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

» Die taktische Untergewichtung von Rohstoffen förderte die relative Wertentwicklung, da die Rohstoffpreise zurückgingen.

» Die Kurvenpositionierung in auf Euro lautenden Derivaten, insbesondere die Untergewichtung des Engagements in Zinsswaps im 2-jährigen Bereich der Swapkurve, trug zur relativen Wertentwicklung bei, da die Swapsätze im 2-jährigen Bereich der Kurve anstiegen.

» Die Untergewichtung im Engagement bei nominalen deutschen Staatszinsen begünstigte die relative Wertentwicklung, da die nominalen deutschen Renditen anstiegen.

» Die Untergewichtung im Engagement bei nominalen japanischen Staatszinsen belastete die relative Wertentwicklung, da die nominalen Renditen in Japan zurückgingen.

» Die Titelauswahl in Immobilieninvestmentgesellschaften beeinträchtigte die relative Wertentwicklung.

» Die Übergewichtung des Engagements in den japanischen Yen, die durch eine Untergewichtung des US-Dollars finanziert wurde, war der relativen Wertentwicklung abträglich, da der Yen gegenüber dem US-Dollar an Wert verlor.

Gesamtrendite, ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2023 abgelaufenen Berichtszeitraum[1]

	6 Monate	Auflegung von Klassen
Auf USD lautende Klassen		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 05. Dez. 2002)	0,83 %	2,23 %
Institutional, ausschüttend (Auflegung: 05. Dez. 2002)	0,83 %	2,22 %
Investor, thesaurierend (Auflegung: 13. Mai 2004)	0,68 %	1,91 %
Investor, ausschüttend (Auflegung: 03. Jul. 2003)	0,74 %	1,80 %
Administrative, thesaurierend (Auflegung: 08. Sep. 2004)	0,56 %	1,71 %
Class E, thesaurierend (Auflegung: 21. Sep. 2007)	0,41 %	1,08 %
Class E, ausschüttend (Auflegung: 28. Okt. 2005)	0,40 %	1,38 %
H Institutional, thesaurierend (Auflegung: 04. Nov. 2009)	0,77 %	1,23 %
H Institutional, ausschüttend (Auflegung: 12. Dez. 2018)	0,71 %	0,44 %
Class R, thesaurierend (Auflegung: 30. Nov. 2012)	0,67 %	0,48 %
ICE BofA Merrill Lynch 1-3 Year U.S. Treasury Index	0,97 %	1,73 %[2]
Auf EUR lautende Klassen		
Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 30. Jan. 2012)	(0,31 %)	(0,28 %)
Institutional EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Dez. 2005)	(0,37 %)	1,28 %
Class E EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 24. Jul. 2009)	(0,76 %)	(0,41 %)
ICE BofA Merrill Lynch 1-3 Year U.S. Treasury Index (EUR Hedged)	(0,23 %)	0,72 %[2]
Auf GBP lautende Klassen		
Institutional GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 20. Jan. 2017)	0,41 %	(0,33 %)
Institutional GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 01. Mrz. 2010)	0,37 %	0,88 %
ICE BofA Merrill Lynch 1-3 Year U.S. Treasury Index (GBP Hedged)	0,50 %	0,43 %[2]

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

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

Anlageziel und Überblick über die Strategie

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

Kommentare zum Fonds

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

» Das Engagement in ausgewählten Positionen an verbrieften Krediten, insbesondere Collateralized Loan Obligations (CLO), trug zur relativen Wertentwicklung bei, da sich die Spreads verengten.

» Das Long-Engagement in den brasilianischen Real trug zur Wertentwicklung bei, da der Real gegenüber dem US-Dollar an Wert gewann.

» Das ausgewählte Engagement in hochverzinsliche Unternehmensanleihen, insbesondere im Sektor Finanzen, war der relativen Wertentwicklung zuträglich, da die Spreads schrumpften.

» Die Untergewichtung der Credit-Default-Swap-Indizes von Unternehmensanleihen mit Investment Grade war der relativen Wertentwicklung abträglich, da sich die Spreads von Unternehmensanleihen mit Investment Grade verengten.

» Die Untergewichtung in japanischer Duration schmälerte die relative Wertentwicklung, da die Zinsen einen Abstieg verzeichneten.

» Die Übergewichtung des Engagements in hypothekenbesicherten Wertpapieren (MBS) mit Agency-Schuldtiteln schmälerte die relative Wertentwicklung, da sich die Spreads in diesem Sektor erweiterten.

Gesamtrendite, ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2023 abgelaufenen Berichtszeitraum[1]

	6 Monate	Auflegung von Klassen
Auf USD lautende Klassen		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 28. Feb. 2014)	2,01 %	1,68 %
Institutional, ausschüttend (Auflegung: 22. Jun. 2021)	1,95 %	(2,38 %)
Bloomberg Global Aggregate Credit 1-5 Years Index (USD Hedged)	1,94 %	1,70 %[2]
Auf EUR lautende Klassen		
Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 28. Feb. 2014)	0,80 %	0,05 %
Institutional EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 03. Jun. 2021)	0,84 %	(4,07 %)
Class E EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 28. Feb. 2014)	0,33 %	(0,85 %)
Bloomberg Global Aggregate Credit 1-5 Years Index (EUR Hedged)	0,72 %	0,05 %[2]
Auf GBP lautende Klassen		
Institutional GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 28. Feb. 2014)	1,58 %	0,97 %
Institutional GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 03. Jun. 2021)	1,52 %	(2,91 %)
Bloomberg Global Aggregate Credit 1-5 Years Index (GBP Hedged)	1,47 %	0,98 %[2]
Auf NOK lautende Klassen		
Institutional NOK (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 10. Jul. 2017)	1,06 %	0,28 %
Bloomberg Global Aggregate Credit 1-5 Years Index (NOK Hedged)	1,03 %	0,54 %

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

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

Anlageziel und Überblick über die Strategie

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

Kommentare zum Fonds

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

» Die Wertpapierauswahl bei Banken trug zur Wertentwicklung bei, da die Übergewichtung des Engagements in vorrangigen Schuldtiteln einer ausgewählten Schweizer Bank aufgrund einer Übernahme durch einen höher bewerteten Wettbewerber überdurchschnittlich abschnitt.

» Die Titelauswahl in Finanzgesellschaften trug zur Wertentwicklung bei, da sich die Übergewichtung ausgewählter Emittenten gegenüber dem Gesamtmarkt überdurchschnittlich entwickelte.

» Die Untergewichtung regierungsnaher Unternehmen trug zur Wertentwicklung bei, da sich der Sektor unterdurchschnittlich entwickelte.

» Makrostrategien und insbesondere die Kurvenpositionierung in den USA belasteten die Wertentwicklung.

» Die Titelauswahl im Sektor Lebensmittel war der Wertentwicklung abträglich, da die Übergewichtung eines ausgewählten US-Emittenten zurückblieb.

Gesamtrendite, ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2023 abgelaufenen Berichtszeitraum[1]

	6 Monate	Auflegung von Klassen
Auf USD lautende Klassen		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 31. Mai 2018)	3,67 %	2,42 %
Institutional, ausschüttend (Auflegung: 31. Mai 2018)	3,63 %	2,43 %
Class E, thesaurierend (Auflegung: 31. Mai 2018)	3,15 %	1,54 %
Class E, ausschüttend (Auflegung: 14. Sep. 2018)	3,13 %	1,52 %
H Institutional, thesaurierend (Auflegung 03. Sep. 2020)	3,56 %	1,64 %
H Institutional, ausschüttend (Auflegung: 18. Jan. 2022)	3,55 %	(0,05 %)
Bloomberg U.S. Aggregate 1-3 Years Index	1,15 %	1,06 %[2]
Auf EUR lautende Klassen		
Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 31. Mai 2018)	2,52 %	0,35 %
Institutional EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 22. Nov. 2021)	2,48 %	(1,82 %)
Class E EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 31. Mai 2018)	1,99 %	(0,54 %)
Class E EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 31. Mai 2018)	2,01 %	(0,53 %)
Class Z EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung 03. Jun. 2020)	2,74 %	1,57 %
Bloomberg U.S. Aggregate 1-3 Years Index (EUR Hedged)	(0,06 %)	(0,94 %)[2]
Auf GBP lautende Klassen		
Institutional GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 31. Mai 2018)	3,18 %	1,34 %
Institutional GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 31. Mai 2018)	3,26 %	1,35 %
Bloomberg U.S. Aggregate 1-3 Years Index (GBP Hedged)	0,69 %	0,15 %
Auf SGD lautende Klassen		
Institutional SGD (Hedged), thesaurierend (Auflegung 14. Okt. 2020)	3,06 %	1,57 %
Bloomberg U.S. Aggregate 1-3 Years Index (SGD Hedged)	0,57 %	(1,28 %)

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

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

Anlageziel und Überblick über die Strategie

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

Kommentare zum Fonds

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

» Das Long-Engagement in Schuldtiteln mit Investment Grade und hochverzinslichen Unternehmensanleihen trug zur Wertentwicklung bei, da sich die Spreads verengten.

» Das Long-Engagement in verbrieften Krediten, insbesondere in hypothekenbesicherten europäischen und US-Wertpapieren ohne Agency-Schuldtitel truge zur Wertentwicklung bei, da sich die Spreads verengten.

» Das Long-Engagement bei ausgewählten Währungen von Schwellenländern war der Wertentwicklung zuträglich, da die Währungen gegenüber dem US-Dollar an Wert gewannen.

» Das Short-Engagement in japanischer Duration schmälerte die Wertentwicklung, da die japanischen Zinsen einen Anstieg verzeichneten.

» Das Long-Engagement in US-Duration schmälerte die Wertentwicklung, da die US-Zinsen anstiegen.

» Das taktische Engagement in den japanischen Yen schmälerte die Wertentwicklung, da der japanische Yen gegenüber dem US-Dollar nachgab.

Gesamtrendite, ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2023 abgelaufenen Berichtszeitraum[1]

	6 Monate	Auflegung von Klassen
Auf USD lautende Klassen		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 29. Jan. 2016)	2,28 %	1,55 %
Institutional, ausschüttend (Auflegung: 07. Mrz. 2019)	2,25 %	0,41 %
Class R, thesaurierend (Auflegung: 15. Sep. 2021)	2,60 %	(2,94 %)
ICE BofA SOFR Overnight Rate Index[3]	2,40 %	1,43 %[2]
Auf EUR lautende Klassen		
Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 29. Jan. 2016)	1,15 %	(0,42 %)
Institutional EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 04. Apr. 2018)	1,11 %	(1,16 %)
Investor EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 30. Jan. 2018)	0,99 %	(1,57 %)
Class E EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 20. Okt. 2017)	0,79 %	(1,97 %)
Euro Short-Term Rate (ESTER) Index[4]	1,34 %	(0,16 %)[2]
Auf GBP lautende Klassen		
Institutional GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 29. Jan. 2016)	1,85 %	0,60 %
Institutional GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 29. Jan. 2019)	1,77 %	(0,30 %)
ICE BofA SONIA Overnight Rate Index[5]	2,06 %	0,77 %[2]

1 *Wertentwicklung auf Jahresbasis für Berichtszeiträume von mindestens einem Jahr, ansonsten kumulativ.*
2 *Die Wertentwicklung des Vergleichsindex seit der Auflegung wird ab dem Auflegungsdatum der ältesten Anteilsklasse berechnet.*
3 *Die Wertentwicklung des Vergleichsindex für den Low Duration Opportunities Fund repräsentiert Folgendes: Auflegung bis 30. Juni 2022: 1 Month USD LIBOR Index; ab 01. Juli 2022: ICE BofA SOFR Overnight Rate Index*
4 *Die Wertentwicklung des Vergleichsindex für den Low Duration Opportunities Fund repräsentiert Folgendes: Auflegung bis 30. Juni 2021: 1 Month Euribor Index; ab 01. Juli 2021: Euro Short-Term Rate (ESTER) Index*
5 *Die Wertentwicklung des Vergleichsindex für den Low Duration Opportunities Fund repräsentiert Folgendes: Auflegung bis 30. Juni 2021: 1 Month GBP LIBOR Index; ab 01. Juli 2021: ICE BofA SONIA Overnight Rate Index*

Anlageziel und Überblick über die Strategie

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

Kommentare zum Fonds

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

» Das Long-Engagement in Unternehmensanleihen mit Investment Grade trug zur Wertentwicklung bei, da sich die Spreads auf diese Wertpapiere verengten.

» Das Long-Engagement in brasilianische Zinsen trug zur Wertentwicklung bei, da die brasilianischen Zinsen fielen.

» Das Long-Engagement in den brasilianischen Real trug zur Wertentwicklung bei, da die Währung gegenüber dem US-Dollar an Wert verlor.

» Das Long-Engagement in Collateralized Loan Obligations („CLO“) mit AAA-Rating leistete einen positiven Beitrag zur Wertentwicklung, da sich die Spreads auf diese Wertpapiere verengten.

» Das Engagement in hochverzinslichen Unternehmensanleihen belastete die Wertentwicklung, da diese Wertpapiere negative Renditen verbuchten.

» Das Long-Engagement in US-Duration schmälerte die Wertentwicklung, da die US-Zinsen anstiegen.

» Das Long-Engagement in den japanischen Yen schmälerte die Wertentwicklung, da die Währung gegenüber dem US-Dollar an Wert verlor.

» Das Short-Engagement in polnische Zinsen war der Wertentwicklung abträglich, da die polnischen Zinsen fielen.

Gesamtrendite, ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2023 abgelaufenen Berichtszeitraum[1]

	6 Monate	Auflegung von Klassen
Auf USD lautende Klassen		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 27. Jul. 2022)	1,52 %	0,50 %
Institutional, ausschüttend (Auflegung: 27. Jul. 2022)	1,43 %	0,48 %
ICE BofA SOFR Overnight Rate Index	2,40 %	3,78 %
Auf EUR lautende Klassen		
Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 27. Jul. 2022)	0,31 %	(1,90 %)
Institutional EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 27. Jul. 2022)	0,27 %	(1,89 %)
Euro Short-Term Rate (ESTER)	1,35 %	1,68 %
Auf GBP lautende Klassen		
Institutional GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 27. Jul. 2022)	1,02 %	(0,50 %)
Institutional GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 27. Jul. 2022)	1,02 %	(0,53 %)
ICE BofA SONIA Overnight Rate Index	2,06 %	3,09 %

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

Anlageziel und Überblick über die Strategie

Der Low Duration Opportunities ESG Fund ist bestrebt, die maximal mögliche langfristige Rendite bei gleichzeitigem Kapitalerhalt und umsichtiger Anlageverwaltung zu erzielen. Der Fonds verfolgt dieses Anlageziel, indem er unter normalen Bedingungen mindestens zwei Drittel des Vermögens in ein diversifiziertes Portfolio aus festverzinslichen Anlagen mit unterschiedlichen Laufzeiten anlegt. Die durchschnittliche Portfolioduration dieses Fonds bewegt sich normalerweise zwischen 1 negativen bis 5 positiven Jahren, je nach der Prognose der Anlageverwaltungsgesellschaften für den Zinssatz. Der Fonds ist bestrebt, unter normalen Marktbedingungen ökologische und soziale Merkmale zu bewerben (wie in der Ergänzung für den Fonds dargelegt) und einen Teil des Vermögens in nachhaltige Anlagen zu investieren.

Kommentare zum Fonds

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

» Das Long-Engagement in Investitionskredite trug zur Wertentwicklung bei, da sich die Spreads auf diese Wertpapiere verengten.

» Die Position bei hypothekenbesicherten Wertpapieren mit Agency-Schuldtiteln trug zur Wertentwicklung bei, insbesondere gegen Ende des Halbjahres, da sich die Spreads im Mai und Juni verengten.

» Das Long-Engagement in Euro-Duration trug zur Wertentwicklung bei, insbesondere die Kurvenpositionierung, da sich die europäische Renditekurve weiter umkehrte.

» Das Long-Engagement bei US-Duration schmälerte die Wertentwicklung, da die US-Zinsen anstiegen.

» Das Short-Engagement in den Euro schmälerte die Wertentwicklung, da die Währung gegenüber dem US-Dollar nachgab.

Gesamtrendite, ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2023 abgelaufenen Berichtszeitraum[1]

	6 Monate	Auflegung von Klassen
Auf USD lautende Klassen		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 25. Nov. 2014)	4,13 %	0,67 %
Institutional, ausschüttend (Auflegung: 25. Nov. 2014)	4,11 %	0,66 %
Class E, ausschüttend (Auflegung: 25. Nov. 2014)	3,61 %	(0,51 %)
Class Z, thesaurierend (Auflegung: 07. Jun. 2019)	4,66 %	7,63 %
Alerian MLP Index	9,70 %	(1,20 %)[2]
Auf EUR lautende Klassen		
Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 25. Nov. 2014)	2,77 %	(1,36 %)
Institutional EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 25. Nov. 2014)	2,75 %	(1,35 %)
Alerian MLP Index EUR (Hedged)	8,23 %	(2,91 %)
Auf GBP lautende Klassen		
Institutional GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 25. Nov. 2014)	3,65 %	(1,12 %)
Alerian MLP Index GBP (Hedged)	8,97 %	(2,79 %)

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

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

Anlageziel und Überblick über die Strategie

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

Kommentare zum Fonds

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

» Das Engagement bei Aktien von Midstream-Energieunternehmen begünstige die absolute Rendite, da der Sektor positive Renditen verzeichnete.

» Die Titelauswahl im Sektor Nicht-Basiskonsumgüter trug zur relativen Rendite bei, da sich die Position des Fonds in diesem Sektor überdurchschnittlich entwickelte.

» Die Titelauswahl bei Verflüssigungsunternehmen trug zur relativen Rendite bei, da sich die Position des Fonds in diesem Sektor überdurchschnittlich entwickelte.

» Die Untergewichtung von Marketing- und Vertriebsunternehmen trug zu den relativen Renditen bei, da der Sektor negative Renditen erzielte.

» Die Titelauswahl im Teilsektor für Erdgasbeförderung in Pipelines war den relativen Renditen abträglich, da sich die Position des Fonds in diesem Sektor unterdurchschnittlich entwickelte.

» Die Untergewichtung des Teilsektors für Erdgasbeförderung in Pipelines belastete die relativen Renditen, da der Teilsektor eine Outperformance erzielte und sich die Position des Fonds in diesem Sektor unterdurchschnittlich entwickelte.

Gesamtrendite, ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2023 abgelaufenen Berichtszeitraum[1]

	6 Monate	Auflegung von Klassen
Auf USD lautende Klassen		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 25. Jan. 2017)	2,23 %	1,47 %
Institutional, ausschüttend (Auflegung: 25. Jan. 2017)	2,35 %	1,49 %
Investor, thesaurierend (Auflegung: 12. Mai 2017)	2,14 %	0,83 %
Investor, ausschüttend (Auflegung: 25. Jan. 2017)	2,13 %	1,13 %
Administrative, ausschüttend (Auflegung: 25. Jan. 2017)	2,03 %	0,98 %
Class E, thesaurierend (Auflegung: 25. Jan. 2017)	1,86 %	0,58 %
Class E, ausschüttend (Auflegung: 25. Jan. 2017)	1,87 %	0,57 %
H Institutional, thesaurierend (Auflegung: 14. Mai 2020)	2,22 %	0,35 %
ICE BofA SOFR Overnight Rate Index[3]	2,40 %	1,73 %[2]
Auf CAD lautende Klassen		
Institutional CAD (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 01. Jun. 2021)	2,05 %	(2,68 %)
ICE BofA SOFR Overnight Rate Index (CAD Hedged)[3]	2,13 %	1,74 %
Auf CHF lautende Klassen		
Institutional CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 25. Jan. 2017)	0,21 %	(1,02 %)
Class E CHF (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 09. Aug. 2017)	(0,12 %)	(2,42 %)
ICE BofA SOFR Overnight Rate Index (CHF Hedged)[3]	0,30 %	(0,79 %)[2]
Auf EUR lautende Klassen		
Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 25. Jan. 2017)	1,15 %	(0,54 %)
Institutional EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 25. Jan. 2017)	1,11 %	(0,54 %)
Class E EUR (Hedged), thesaurierende Anteile (Auflegung: 25. Jan. 2017)	0,66 %	(1,44 %)
ICE BofA SOFR Overnight Rate Index (EUR Hedged)[3]	1,25 %	(0,27 %)
Auf GBP lautende Klassen		
Institutional GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 25. Jan. 2017)	1,88 %	0,48 %
Institutional GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 25. Jan. 2017)	1,92 %	0,47 %
ICE BofA SOFR Overnight Rate Index (GBP Hedged)[3]	1,96 %	0,76 %

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

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

3 *Die Wertentwicklung des Vergleichsindex für den Mortgage Opportunities Fund repräsentiert Folgendes: Auflegung bis 30. Juni 2022: 3 Month USD LIBOR Index; ab 01. Juli 2022: ICE BofA SOFR Overnight Rate Index*

Anlageziel und Überblick über die Strategie

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

Kommentare zum Fonds

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

» Das Engagement in vorrangigen forderungsbesicherten Wertpapieren (ABS) begünstigte die Wertentwicklung, da die Anlageklasse positive Renditen erzielte.

» Das Engagement in vorrangigen Residential Mortgage-Backed Securitys (RMBS) kam der Wertentwicklung zugute, da sich die Spreads verschmälerten.

» Das Engagement in vorrangigen Collateralized Loan Obligations (CLO) trug zur Wertentwicklung bei, da die Anlageklasse eine positive Rendite verzeichnete.

» Die „Relative Value“-Strategien mit MBS mit Agency-Schuldtiteln belasteten die Wertentwicklung, da sich die Spreads leicht ausweiteten

» Das Engagement in US-Zinsen belastete die Wertentwicklung, da die Zinssätze stiegen.

» Positionen in hypothekenbesicherten Wertpapieren (MBS) mit strukturierten Agency-Schuldtiteln, insbesondere endfällige Positionen, schmälerten die Wertentwicklung, da der Sektor negative Renditen erzielte.

Gesamtrendite, ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2023 abgelaufenen Berichtszeitraum[1]

	6 Monate	Auflegung von Klassen
Auf USD lautende Klassen		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 31. Dez. 1998)	16,81 %	7,18 %
Institutional, ausschüttend (Auflegung: 22. Nov. 2001)	16,81 %	8,41 %
Investor, thesaurierend (Auflegung: 07. Jan. 1999)	16,61 %	6,68 %
BE Retail, thesaurierend (Auflegung: 28. Apr. 2022)	15,59 %	0,09 %
Class E, thesaurierend (Auflegung: 11. Sep. 2006)	16,27 %	8,58 %
H Institutional, thesaurierend (Auflegung: 08. Jan. 2020)	16,67 %	9,36 %
S&P 500 Index (nach Abzug der Quellensteuer auf Dividenden)	16,60 %	6,78 %[2]
Auf EUR lautende Klassen		
Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 28. Sep. 2012)	15,35 %	10,98 %
Class E EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung 02. Aug. 2017)	14,81 %	7,62 %
S&P (EUR Hedged) 500 Index (nach Abzug der Quellensteuer auf Dividenden)	14,97 %	10,64 %[2]
Auf GBP lautende Klassen		
Institutional GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 17. Jun. 2021)	16,05 %	(0,10 %)
S&P (GBP Hedged) 500 Index (nach Abzug der Quellensteuer auf Dividenden)	15,69 %	2,04 %
Auf SGD lautende Klassen		
Institutional SGD (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 22. Apr. 2022)	16,21 %	1,51 %
S&P 500 (SGD Hedged) Index (Net Total Return)	17,65 %	3,70 %

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

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

Anlageziel und Überblick über die Strategie

Der StocksPLUS™ Fund ist bestrebt, eine bessere Rendite als die Entwicklung der Gesamtrendite von Standard & Poor's 500 Composite Stock Price Index („S&P 500") zu erzielen. Dazu wendet der Fonds eine gesellschaftseigene Portfolioverwaltungsstrategie an, die ein aktiv verwaltetes Portfolio festverzinslicher Wertpapiere (wie im Verkaufsprospekt angegeben) mit einem Engagement in den S&P 500 verbindet. Der Fonds darf unbeschränkt in Aktien und Wertpapiere anlegen, die sich in Aktien wandeln lassen.

Kommentare zum Fonds

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

» Das Engagement des Fonds bei mit dem S&P 500 Index verbundenen Aktienindexderivaten wirkte sich positiv auf die absolute Rendite aus, da der S&P 500 Net Total Return Index eine Rendite in Höhe von 16,60 % verbuchte.

» Die Alpha-Anleihestrategie des Fonds trug zur Rendite bei. Die Wertentwicklung war vor allem auf die folgenden Faktoren zurückzuführen:

  » Das Long-Engagement in Unternehmensanleihen mit Investment Grade trug zur Rendite bei, die Positionen wurden erhöht und der Wert dieser Anleihen stieg anschließend.

  » Die Position bei hypothekenbesicherten Wertpapieren ohne Agency-Schuldtitel trugen zur Rendite bei, da der Wert dieser Anleihen zulegte.

  » Das Long-Engagement in US-Zinsätzen waren der Wertentwicklung abträglich, da die Zinssätze anstiegen.

  » Das Short-Engagement in hochverzinslichen Unternehmensanleihen belastete die Wertentwicklung, da sich die Spreads verengten.

Gesamtrendite, ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2023 abgelaufenen Berichtszeitraum[1]

	6 Monate	Auflegung von Klassen
Auf USD lautende Klassen		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 29. Mrz. 2019)	17,20 %	12,47 %
S&P 500 Index (nach Abzug der Quellensteuer auf Dividenden)	16,60 %	12,51 %
Auf GBP lautende Klassen		
Institutional GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 17. Jun. 2021)	16,65 %	0,10 %
S&P (GBP Hedged) 500 Index (nach Abzug der Quellensteuer auf Dividenden)	15,69 %	2,04 %

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

Anlageziel und Überblick über die Strategie

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

Kommentare zum Fonds

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

- Das Engagement des Fonds bei mit dem S&P 500 Index verbundenen Aktienindexderivaten wirkte sich positiv auf die absolute Rendite aus, da der S&P 500 Net Total Return Index eine Rendite in Höhe von 16,60 % verbuchte.
- Die Alpha-Anleihestrategie des Fonds trug zur Rendite bei. Die Wertentwicklung war vor allem auf die folgenden Faktoren zurückzuführen:
  - Das Long-Engagement in Unternehmensanleihen mit Investment Grade trug zur Rendite bei, da der Wert dieser Anleihen stieg.
  - Die Positionen bei Collateralized Loan Obligations trugen zur Rendite bei, da der Wert dieser Anleihen zulegte.
  - Das Long-Engagement in US-Zinsätzen waren der Wertentwicklung abträglich, da die Zinssätze anstiegen.
  - Das Long-Engagement in hypothekenbesicherten Wertpapieren mit Agency-Sicherungen schmälerte die Wertentwicklung, da die ausgewählten Anleihen an Wert verloren.

Gesamtrendite, ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2023 abgelaufenen Berichtszeitraum[1]

	6 Monate	Auflegung von Klassen
Auf USD lautende Klassen		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 14. Mrz. 2018)	3,38 %	2,86 %
Class E, thesaurierend (Auflegung: 16. Dez. 2013)	2,93 %	3,34 %
Class E, ausschüttend II (Auflegung: 16. Dez. 2013)	2,91 %	3,33 %
75 % Bloomberg U.S. Aggregate Bond Index/25 % MSCI ACWI High Dividend Yield Index[3]	2,53 %	3,55 %[2]
Auf EUR lautende Klassen		
Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 16. Dez. 2013)	2,19 %	2,86 %
Class E EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 16. Dez. 2013)	1,87 %	1,92 %
Class E EUR (Hedged), ausschüttend II (Auflegung: 16. Dez. 2013)	1,81 %	1,92 %
Class T EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 30. Sep. 2014)	1,62 %	0,75 %
Class T EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Sep. 2014)	1,67 %	0,77 %
75 % Bloomberg U.S. Aggregate Bond Index (EUR Hedged)/25 % MSCI ACWI High Dividend Yield Index (EUR Hedged)[3]	1,27 %	2,19 %[2]
Auf GBP lautende Klassen		
Institutional GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 29. Jul. 2022)	2,98 %	1,88 %
75 % Bloomberg U.S. Aggregate Bond Index (GBP Hedged)/25 % MSCI ACWI High Dividend Yield Index (GBP Hedged)[3]	2,05 %	(2,52 %)

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

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

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

Anlageziel und Überblick über die Strategie

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

Kommentare zum Fonds

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

Paket mit festverzinslichen Anlagen:

» Die Positionen in Hochzinsanleihen trugen zur Wertentwicklung bei, da die Spreads auf diese Wertpapiere schrumpften.

» Die Positionen in Engagement in Unternehmensanleihen mit Investment Grade trugen zur Wertentwicklung bei, da sich die Spreads auf diese Wertpapiere verengten.

» Das Long-Engagement in russischen lokalen Staatsanleihen trug zur Wertentwicklung bei, da diese Wertpapiere an Wert gewannen.

» Das Long-Engagement in den brasilianischen Real war der Wertentwicklung zuträglich, da die Währung gegenüber dem US-Dollar nachgab.

» Das Short-Engagement in japanischer Duration schmälerte die Wertentwicklung, da die japanischen Zinsen einen Abstieg verzeichneten.

» Das Long-Engagement in US-Duration schmälerte die Wertentwicklung, da die US-Zinsen anstiegen.

» Die Positionen bei hypothekenbesicherten Wertpapieren ohne Agency-Schuldtitel schmälerten die absolute Wertentwicklung, da diese Wertpapiere an Wert verloren.

» Das taktische Engagement in den japanischen Yen schmälerte die Wertentwicklung, da die Währung gegenüber dem US-Dollar an Wert verlor.

Paket mit Aktien:

» Die Titelauswahl im Sektor Finanzen trug zur relativen Rendite bei, da sich die Positionen des Fonds im Sektor Finanzen besser entwickelten als die des Vergleichsindex.

» Die Titelauswahl im Sektor Energie trug zur relativen Rendite bei, da sich die Positionen des Fonds im Sektor Energie besser entwickelten als die des Vergleichsindex.

» Die Untergewichtung des Engagements und die Titelauswahl im Sektor Versorgung trugen zur relativen Rendite bei, da sich der Sektor schwächer entwickelte als der Vergleichsindex und sich die Positionen des Fonds im Sektor Versorgung besser entwickelten als die des Vergleichsindex.

» Die Titelauswahl im Sektor Basiskonsumgüter belastete die relative Rendite, da sich die Positionen des Fonds im Sektor Basiskonsumgüter schlechter entwickelten als die des Vergleichsindex.

» Die Übergewichtung des Engagements und die Titelauswahl im Sektor Gesundheitswesen belasteten die relative Rendite, da sich der Sektor schwächer entwickelte als der Vergleichsindex und sich die Positionen des Fonds im Sektor Gesundheitswesen schlechter entwickelten als die des Vergleichsindex.

» Die Titelauswahl im Sektor Industrie belastete die relative Rendite, da sich die Positionen des Fonds im Sektor Industrie schlechter entwickelten als die des Vergleichsindex.

Taktisches Paket

» Es gab ansonsten keine Faktoren, die einen wesentlichen Beitrag zu diesem Fonds leisteten.

» Das Engagement in den Sektor Immobilien belastete die Rendite, da der Sektor negative Renditen verzeichnete.

Gesamtrendite, ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2023 abgelaufenen Berichtszeitraum[1]

	6 Monate	Auflegung von Klassen
Auf USD lautende Klassen		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 31. Jan. 1998)	2,15 %	4,35 %
Institutional, ausschüttend (Auflegung: 25. Apr. 2000)	2,17 %	4,32 %
Investor, thesaurierend (Auflegung: 28. Jan. 1999)	1,96 %	3,79 %
Investor, ausschüttend (Auflegung: 23. Okt. 2000)	1,98 %	3,75 %
Administrative, thesaurierend (Auflegung: 16. Mai 2003)	1,91 %	2,88 %
Administrative, ausschüttend (Auflegung: 21. Jul. 2022)	1,90 %	(2,20 %)
Class E, thesaurierend (Auflegung: 31. Mrz. 2006)	1,69 %	2,61 %
Class E, ausschüttend (Auflegung: 10. Okt. 2005)	1,71 %	2,52 %
H Institutional, thesaurierend (Auflegung: 15. Okt. 2002)	2,07 %	3,51 %
H Institutional, ausschüttend (Auflegung: 25. Mai 2018)	2,09 %	0,38 %
Class T, thesaurierend (Auflegung: 16. Okt. 2014)	1,53 %	(0,08 %)
Bloomberg U.S. Aggregate Index	2,09 %	3,94 %[2]
Auf CAD lautende Klassen		
Institutional CAD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 02. Mai 2013)	1,82 %	0,84 %
Bloomberg U.S. Aggregate (CAD Hedged) Index	1,74 %	1,02 %
Auf CHF lautende Klassen		
Institutional CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 24. Jun. 2011)	0,00 %	(0,18 %)
Investor CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 24. Jun. 2011)	(0,21 %)	(0,52 %)
Class E CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 19. Sept. 2012)	(0,48 %)	(1,71 %)
Bloomberg U.S. Aggregate (CHF Hedged) Index	(0,16 %)	(0,16 %)[2]
Auf EUR lautende Klassen		
Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 30. Dez. 2003)	0,83 %	2,48 %
Institutional EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Dez. 2005)	0,83 %	2,38 %
Investor EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 30. Dez. 2004)	0,66 %	1,99 %
Administrative EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 14. Okt. 2009)	0,65 %	0,64 %
Class E EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 31. Mrz. 2006)	0,36 %	1,57 %
Class E EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 07. Mrz. 2012)	0,37 %	(0,82 %)
Class R EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 30. Nov. 2012)	0,65 %	(0,70 %)
Class T EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 30. Sep. 2014)	0,23 %	(1,76 %)
Bloomberg U.S. Aggregate (EUR Hedged) Index	0,74 %	2,06 %[2]
Auf EUR lautende Klassen (nicht abgesichert)		
Institutional EUR (Unhedged), thesaurierend (Auflegung: 13. Jun. 2002)	(0,07 %)	2,98 %
E Class EUR (Unhedged), thesaurierend (Auflegung: 03. Mrz. 2021)	(0,52 %)	(2,27 %)
Bloomberg U.S. Aggregate Index (EUR Unhedged) Index	(0,13 %)	2,65 %[2]
Auf GBP lautende Klassen		
Institutional GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 26. Mrz. 2010)	1,63 %	1,66 %
Institutional GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Dez. 2005)	1,71 %	3,21 %
Bloomberg U.S. Aggregate (GBP Hedged) Index	1,51 %	2,82 %[2]
Auf HKD lautende Klassen		
M Retail HKD (Unhedged), ausschüttend (Auflegung: 20. Feb. 2013)	2,14 %	0,31 %
Bloomberg U.S. Aggregate (HKD Unhedged) Index	2,51 %	1,39 %
Auf SGD lautende Klassen		
Institutional SGD (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 11. Jan. 2011)	1,48 %	1,71 %
Administrative SGD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 23. Feb. 2023)	—	0,39 %
Class E SGD (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 15. Feb. 2007)	1,02 %	2,08 %
Bloomberg U.S. Aggregate (SGD Hedged) Index	1,40 %	2,61 %[2]

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

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

Anlageziel und Überblick über die Strategie

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

Kommentare zum Fonds

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

» Die taktische US-Durationspositionierung, insbesondere eine Übergewichtung des mittleren Bereichs der Renditekurve, trug zur relativen Wertentwicklung bei, da die Renditen im Q1 2023 einen Verlust verzeichneten.

» Die Positionen in hypothekenbesicherten Wertpapieren (MBS) ohne Agency-Schuldtitel und anderen verbrieften Vermögenswerten trugen besonders in Q2 zur relativen Wertentwicklung bei, da sich die Spreads verengten.

» Die Auswahl in Unternehmensanleihen mit Investment Grade, insbesondere eine Bevorzugung von Finanzwerten, trug zur relativen Wertentwicklung bei, da die Spreads im Q2 2023 schrumpften.

» Die Zinsstrategien in der Eurozone, insbesondere eine Tendenz, einen steileren Verlauf der Kurve zu erzielen, schmälerten die relative Wertentwicklung, da sich die Kurve abflachte.

» Das Short-Engagement in japanischer Duration schmälerte die relative Wertentwicklung, da die Renditen zurückgingen.

Gesamtrendite, ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2023 abgelaufenen Berichtszeitraum[1]

	6 Monate	Auflegung von Klassen
Auf USD lautende Klassen		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 30. Jun. 2015)	(1,88 %)	2,87 %
Investor, thesaurierend (Auflegung: 23. Sep. 2022)	(2,12 %)	(7,70 %)
Class E, thesaurierend (Auflegung: 30. Jun. 2015)	(2,46 %)	1,75 %
H Institutional, thesaurierend (Auflegung: 23. Aug. 2022)	(1,97 %)	(0,70 %)
Z Class, thesaurierend (Auflegung: 15. Dez. 2021)	(1,25 %)	6,64 %
ICE BofA SOFR Overnight Rate Index[3]	2,40 %	1,51 %[2]
Auf EUR lautende Klassen		
Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 30. Jun. 2015)	(2,92 %)	1,15 %
Investor EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 23. Sep. 2022)	(3,09 %)	(9,00 %)
Class E EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung 30. Jun. 2015)	(3,46 %)	0,05 %
ICE BofA SOFR Overnight Rate Index (EUR Hedged)[3]	1,25 %	(0,18 %)[2]
Auf GBP lautende Klassen		
Institutional GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 18. Nov. 2022)	(2,23 %)	(3,40 %)
Institutional GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 23. Sep. 2022)	(2,27 %)	(7,94 %)
ICE BofA SOFR Overnight Rate Index (GBP Hedged)[3]	1,96 %	2,63 %[2]

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

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

3 *Die Wertentwicklung des Vergleichsindex für den PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund repräsentiert Folgendes: Auflegung bis 30. Juni 2022: 3 Month USD LIBOR Index; ab 01. Juli 2022: ICE BofA SOFR Overnight Rate Index*

Anlageziel und Überblick über die Strategie

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

Kommentare zum Fonds

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

» Der PIMCO GIS TRENDS Managed Futures Strategy Fund strebt positive, risikobereinigte Renditen im Einklang mit einer umsichtigen Anlageverwaltung an, indem er eine quantitative Handelsstrategie verfolgt, die darauf abzielt, die an den globalen Finanzmärkten beobachtete Beständigkeit von Kurstrends (nach oben und/oder unten) zu erfassen. Die Anlagestrategie des Fonds stellt eine Kombination aus Finanzterminkontrakten und Derivaten dar, die darauf ausgelegt sind, ein Engagement in globalen Preistrends auf den Finanzmärkten zu ermöglichen. Innerhalb der Allokationen der Strategie werden die Kontrakte entweder Long- oder Short-Positionen basierend auf verschiedenen Merkmalen hinsichtlich ihrer Kurse aufweisen.

» Die Positionierung in kanadischen, chilenischen und ungarischen Zinssätzen belastete die Wertentwicklung aufgrund von Kursumschwüngen.

» Die Positionierung im thailändischen Baht, in der indischen Rupie und in der indonesischen Rupiah belastete die Wertentwicklung aufgrund von Kurswenden.

» Die Long-Positionen im mexikanischen und im kolumbianischen Peso trugen zur Wertentwicklung bei, da die Währungen gegenüber dem US-Dollar an Wert zulegten. Die Short-Positionen im chinesischen Yuan trugen zur Wertentwicklung bei, da die Währung gegenüber dem US-Dollar an Wert verlor.

» Die Long-Positionen in japanischen, europäischen und US-amerikanischen Aktienindizes trugen aufgrund von Kurssteigerungen zur Wertentwicklung bei.

Gesamtrendite, ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2023 abgelaufenen Berichtszeitraum[1]

	6 Monate	Auflegung von Klassen
Auf GBP lautende Klassen		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 28. Sep. 2007)	(1,47 %)	3,82 %
Institutional, ausschüttend (Auflegung: 08. Jul. 2016)	(1,44 %)	(0,54 %)
Class Z, thesaurierend (Auflegung: 20. Nov. 2019)	(1,29 %)	(4,62 %)
ICE BofA Merrill Lynch Sterling Non-Gilts Index	(1,06 %)	3,60 %[2]

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

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

Anlageziel und Überblick über die Strategie

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

Kommentare zum Fonds

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

» Die Titelauswahl im Sektor Einzelhandel trug zur Wertentwicklung bei, da die Übergewichtung ausgewählter Emittenten aufgrund einer Steigerung der Profitabilität eine Outperformance erzielte.

» Die Titelauswahl im Sektor Immobilienfonds trug zur Wertentwicklung bei, da die Untergewichtung eines ausgewählten Emittenten aufgrund von Bedenken bzgl. der Auswirkungen höherer Zinssätze und strafferer Finanzbedingungen hinter dem Gesamtmarkt zurückblieb.

» Makrostrategien und insbesondere eine Übergewichtung der britischen Duration belasteten die Wertentwicklung, da die Zinssätze aufgrund einer unerwartet hohen Inflation und steigender Leitzinsen abverkauft wurden.

» Die Titelauswahl in den Sektoren Bankwesen und Brokerage war der Wertentwicklung abträglich, da sich das Engagement in nachrangigen Schuldtiteln und insbesondere in einer ausgewählten Schweizer Bank unterdurchschnittlich entwickelte.

» Die Übergewichtung des Engagements in der Versorgung beeinträchtigte die Wertentwicklung, da sich der Sektor unterdurchschnittlich entwickelte.

Gesamtrendite, ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2023 abgelaufenen Berichtszeitraum[1]

	6 Monate	Auflegung von Klassen
Auf GBP lautende Klassen		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 30. Jun. 2005)	(3,05 %)	3,64 %
Institutional, ausschüttend (Auflegung: 14. Aug. 2008)	(3,02 %)	4,54 %
ICE BofA Merrill Lynch Sterling Non-Gilts 10+ Index[3]	(1,62 %)	3,29 %[2]

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

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

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

Anlageziel und Überblick über die Strategie

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

Kommentare zum Fonds

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

» Die Untergewichtung von verbrieften Wertpapieren, die sich unterdurchschnittlich entwickelten, trug zur Wertentwicklung bei.

» Die Titelauswahl im Sektor Einzelhandel trug zur Wertentwicklung bei, da die Übergewichtung eines ausgewählten Emittenten aufgrund angekündigter Einsparmaßnahmen zwecks Steigerung der Profitabilität eine Outperformance erzielte.

» Die Titelauswahl in den Sektoren Bankwesen und Brokerage war der Wertentwicklung abträglich, da sich das Engagement in nachrangigen Schuldtiteln und insbesondere in einer ausgewählten Schweizer Bank unterdurchschnittlich entwickelte.

» Makrostrategien und insbesondere eine Übergewichtung der britischen Duration belasteten die Wertentwicklung, da die Zinssätze aufgrund einer unerwartet hohen Inflation und einer wiederholten Zinsanpassung abverkauft wurden.

» Die Titelauswahl im Sektor Immobilien war der Wertentwicklung abträglich, da das Engagement in einen ausgewählten Emittenten von Immobilieninvestmentfonds aufgrund von Druck auf die Vermögenswerte und negativen Ratings eine Underperformance aufwies.

Gesamtrendite, ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2023 abgelaufenen Berichtszeitraum[1]

	6 Monate	Auflegung von Klassen
Auf USD lautende Klassen		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 28. Mai 1998)	5,36 %	5,43 %
Institutional, ausschüttend (Auflegung: 23. Jan. 2001)	5,28 %	5,74 %
Investor, thesaurierend (Auflegung: 18. Mrz. 1999)	5,16 %	5,08 %
Investor, ausschüttend (Auflegung: 14. Jan. 1999)	5,20 %	5,06 %
Class E, thesaurierend (Auflegung: 31. Mrz. 2006)	4,87 %	4,16 %
Class E, ausschüttend (Auflegung: 31. Jul. 2006)	4,90 %	4,24 %
H Institutional, thesaurierend (Auflegung: 15. Okt. 2002)	5,26 %	6,45 %
H Institutional, ausschüttend (Auflegung: 14. Feb. 2020)	5,35 %	0,07 %
M Retail, ausschüttend (Auflegung: 11. Jan. 2012)	4,89 %	3,83 %
Class R, thesaurierend (Auflegung: 30. Nov. 2012)	5,23 %	3,84 %
Class Z, thesaurierend (Auflegung: 29. Jun. 2016)	5,58 %	4,52 %
ICE BofA Merrill Lynch US High Yield Constrained Index[3]	5,42 %	5,64 %[2]
Auf EUR lautende Klassen		
Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 10. Apr. 2003)	4,03 %	4,77 %
Institutional EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Dez. 2005)	4,01 %	4,00 %
Investor EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 12. Feb. 2003)	3,86 %	4,69 %
Class E EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 31. Mrz. 2006)	3,54 %	3,01 %
ICE BofA Merrill Lynch US High Yield Constrained Index (EUR Hedged)[3]	4,02 %	5,44 %[2]
Auf GBP lautende Klassen		
Institutional GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 30. Sep. 2003)	4,81 %	5,38 %
Institutional GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 22. Jun. 2016)	4,82 %	2,59 %
ICE BofA Merrill Lynch US High Yield Constrained Index (GBP Hedged)[3]	4,78 %	5,86 %[2]

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

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

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

Anlageziel und Überblick über die Strategie

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

Kommentare zum Fonds

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

» Die Titelauswahl in den Sektoren Glücksspiel und Hotellerie trugen zur Wertentwicklung bei, da der Sektor und die Übergewichtung ausgewählter Emittenten den Gesamtmarkt aufgrund der starken Verbrauchernachfrage nach Freizeit- und Unterhaltungsdienstleistungen übertrafen.

» Die Titelauswahl im Sektor Dienstleistungen trug zur Wertentwicklung bei, da sich die Übergewichtung ausgewählter Emittenten überdurchschnittlich entwickelte.

» Die Titelauswahl im Sektor Gesundheitswesen trug zur Wertentwicklung bei, da sich die Übergewichtung ausgewählter Emittenten überdurchschnittlich entwickelte.

» Die Titelauswahl in den Sektoren Medien, Unterhaltung und Verlagswesen war der Wertentwicklung abträglich, da die Übergewichtung ausgewählter Emittenten hinter den Erwartungen zurückblieb.

» Die Untergewichtung und die Titelauswahl im Einzelhandel beeinträchtigten die Wertentwicklung, da der Sektor den Gesamtmarkt übertraf, während die Übergewichtung eines ausgewählten Emittenten eine Underperformance aufwies.

Gesamtrendite, ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2023 abgelaufenen Berichtszeitraum[1]

	6 Monate	Auflegung von Klassen
Auf USD lautende Klassen		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 15. Sep. 2016)	3,89 %	1,36 %
Institutional, ausschüttend (Auflegung: 15. Sep. 2016)	3,96 %	1,36 %
Class E, thesaurierend (Auflegung: 07. Nov. 2019)	3,44 %	(2,79 %)
Class E, ausschüttend (Auflegung: 08. Mrz. 2019)	3,46 %	(0,45 %)
H Institutional, thesaurierend (Auflegung: 23. Aug. 2022)	3,81 %	0,90 %
Bloomberg U.S. Credit Index	3,13 %	1,35 %[2]
Auf EUR lautende Klassen		
Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 15. Sep. 2016)	2,60 %	(0,81 %)
Bloomberg U.S. Credit Index (EUR Hedged)	1,70 %	(0,86 %)
Auf GBP lautende Klassen		
Institutional GBP (Hedged), ausschüttend II (Auflegung: 15. Sep. 2016)	3,35 %	0,13 %
Bloomberg U.S. Credit Index (GBP Hedged)	2,49 %	0,16 %

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

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

Anlageziel und Überblick über die Strategie

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

Kommentare zum Fonds

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

» Die Wertpapierauswahl bei Banken und Brokerage trug zur Wertentwicklung bei, da die Übergewichtung des Engagements in vorrangigen Schuldtiteln eines ausgewählten europäischen Emittenten aufgrund einer Übernahme durch einen höher bewerteten Wettbewerber überdurchschnittlich abschnitt.

» Makrostrategien und insbesondere die US-Durationspositionierung sowie das Engagement in lokalen Zinssätzen von Schwellenländern leisteten einen positiven Beitrag zur Wertentwicklung.

» Die Titelauswahl im Sektor Versorgung trug zur Wertentwicklung bei, da sich die Übergewichtung eines ausgewählten Emittenten überdurchschnittlich entwickelte.

» Die Übergewichtung und die Titelauswahl im Bereich Finanzen „Sonstiges“ beeinträchtigten die Wertentwicklung, da eine ausgewählte Übergewichtung des US-Spezialkreditgebers aufgrund der allgemein schwachen US-Finanzwerte zurückblieb.

» Das Engagement in verbrieften Produkten schmälerte die Wertentwicklung, da ausgewählte forderungsbesicherte und gewerbliche hypothekenbesicherte Wertpapiere zurückblieben.

Gesamtrendite, ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2023 abgelaufenen Berichtszeitraum[1]

	6 Monate	Auflegung von Klassen
Auf USD lautende Klassen		
Institutional, thesaurierend (Auflegung: 30. Jun. 2014)	2,55 %	1,71 %
Institutional, ausschüttend (Auflegung: 11. Mai 2020)	2,65 %	1,44 %
Investor, thesaurierend (Auflegung: 30. Jun. 2014)	2,36 %	1,36 %
Class E, thesaurierend (Auflegung: 30. Jun. 2014)	2,37 %	1,32 %
H Institutional, thesaurierend (Auflegung: 12. Dez. 2018)	2,50 %	1,46 %
Class Z, ausschüttend (Auflegung: 07. Aug. 2014)	2,77 %	2,18 %
FTSE 3-Month Treasury Bill Index	2,39 %	1,08 %[2]
Auf EUR lautende Klassen		
Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 29. Jan. 2016)	1,51 %	0,08 %
Class E EUR (Hedged), thesaurierende Anteile (Auflegung: 08. Jun. 2016)	1,26 %	(0,47 %)
ICE BofA Merrill Lynch 3-Month Treasury Bill Index (EUR Hedged)	1,10 %	(0,60 %)[2]
Auf GBP lautende Klassen		
Institutional GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 31. Mai 2023)	—	0,50 %
ICE BofA Merrill Lynch 3-Month Treasury Bill Index (GBP Hedged)	1,81 %	0,38 %

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

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

Anlageziel und Überblick über die Strategie

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

Kommentare zum Fonds

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

» Die Übergewichtung des Engagements bei Finanzwerten mit Investment Grade und nachrangigen Finanzwerten trug zur relativen Wertentwicklung bei, da sich die Spreads verengten.

» Die Untergewichtung des Engagements in US-Duration trug zur relativen Wertentwicklung bei, da die Zinsen stiegen.

» Die Übergewichtung des Engagements in Collateralized Loan Obligations war der Wertentwicklung zuträglich, da sich die Spreads verengten.

» Die Untergewichtung der Credit-Default-Swap-Indizes von Unternehmensanleihen mit Investment Grade war der relativen Wertentwicklung abträglich, da sich die Spreads von Unternehmensanleihen mit Investment Grade verengten.

» Die Auswahl von hypothekenbesicherten Wertpapieren mit Agency-Schuldtiteln schmälerte die relative Wertentwicklung, da die Spreads schrumpften.

Beschreibungen der Vergleichsindizes

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

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

Beschreibungen der Vergleichsindizes (Forts.)

Offizieller Name des Vergleichsindex	Beschreibung des Index
Bloomberg Global Aggregate Credit Index (USD Hedged)	Beim Bloomberg Barclays Global Aggregate Credit-Index (USD Hedged) handelt es sich um einen nicht verwalteten Index, der ein weites Vergleichsspektrum für die internationalen Rentenmärkte der Kategorie Investment Grade bietet. Die drei Hauptkomponenten dieses Index sind der U.S. Aggregate Index, der Pan-European Aggregate Index sowie der Asian-Pacific Aggregate Index. Dieser Index schließt Staatstitel und verbriefte Wertpapiere aus. Des Weiteren beinhaltet der Index Eurodollar- sowie Euro-Yen-Industrieschuldverschreibungen, kanadische Wertpapiere und US-Dollar-144A-Wertpapiere der Kategorie Investment Grade. In einen nicht gemanagten Index kann man nicht direkt anlegen.
Bloomberg Global Aggregate ex-USD (USD Hedged) Index	Der Bloomberg Global Aggregate ex-USD (USD Hedged) Index bietet ein weites Vergleichsspektrum der internationalen Rentenmärkte der Kategorie Investment Grade. Die drei Hauptkomponenten dieses Index sind der U.S. Aggregate Index, der Pan-European Aggregate Index sowie der Asian-Pacific Aggregate Index. Der Index enthält auch Eurodollar- und Euro-Yen-Unternehmensanleihen, kanadische Staats-, Agency- und Unternehmenswertpapiere sowie auf USD lautende 144A-Wertpapiere mit Investment-Grade-Rating.
Bloomberg MSCI Green Bond Index (USD Hedged)	Der Bloomberg MSCI Green Bond Index, USD Hedged bietet Anlegern ein objektives und robustes Maß für den globalen Markt für festverzinsliche Wertpapiere, die zur Finanzierung von Projekten mit direktem Umweltnutzen ausgegeben werden. Es wird eine unabhängige, analysegestützte Methodik verwendet, um indexfähige grüne Anleihen zu bewerten und sicherzustellen, dass sie die etablierten Green-Bond-Prinzipien einhalten, und um die Anleihen nach der umweltfreundlichen Verwendung ihrer Erlöse zu klassifizieren. In einen nicht gemanagten Index kann man nicht direkt anlegen.
Bloomberg U.S. Aggregate Index	Der Bloomberg U.S. Aggregate Index bildet Wertpapiere ab, die bei der SEC registriert und steuerpflichtig sind sowie auf Dollar lauten. Der Index deckt den erstklassigen US-Festzinsanleihemarkt ab und beinhaltet Indexkomponenten für Staatstitel sowie Industrieschuldverschreibungen, Hypotheken-Durchlauf-Wertpapiere sowie forderungsbesicherte Wertpapiere. Diese Hauptsektoren unterteilen sich in spezifischere Indizes, die regelmäßig berechnet und veröffentlicht werden. In einen nicht gemanagten Index kann man nicht direkt anlegen.
Bloomberg U.S. Aggregate 1-3 Years Index	Der Bloomberg U.S. Aggregate 1-3 Years Index bildet Wertpapiere ab, die bei der SEC registriert und steuerpflichtig sind, auf US-Dollar lauten und eine Laufzeit zwischen ein und drei Jahren haben. Der Index deckt den erstklassigen US-Festzinsanleihemarkt ab und beinhaltet Indexkomponenten für Staatstitel sowie Industrieschuldverschreibungen, Hypotheken-Durchlauf-Wertpapiere sowie forderungsbesicherte Wertpapiere. In einen nicht gemanagten Index kann man nicht direkt anlegen.
Bloomberg U.S. Credit Index	Bei dem Bloomberg U.S. Credit Index handelt es sich um einen nicht gemanagten Index, der aus öffentlich begebenen Schuldverschreibungen von Unternehmen und bestimmten nicht US-amerikanischen Emittenten sowie besicherten Anleihen besteht, die bestimmten Anforderungen in Bezug auf Laufzeit, Liquidität und Qualität entsprechen. Um für den Index in Frage zu kommen, müssen die Anleihen bei der SEC registriert sein. Dieser Index wurde zuvor als Bloomberg Credit Investment Grade Index bezeichnet. In einen nicht gemanagten Index kann man nicht direkt anlegen.
Bloomberg World Government Inflation-Linked Bond (USD Hedged) Index	Mit dem Bloomberg Barclays World Government Inflation-Linked Bond (USD Hedged) Index wird die Wertentwicklung der führenden Märkte für inflationsgekoppelte Staatsanleihen gemessen. Der Index umfasst von den folgenden Ländern emittierte, inflationsgekoppelte Schuldtitel: Australien, Kanada, Frankreich, Schweden, das Vereinigte Königreich und die USA. In einen nicht gemanagten Index kann man nicht direkt anlegen.
Bloomberg World Government Inflation-Linked Bond 1-5 Year Index (USD Hedged)	Bei dem Bloomberg World Government Inflation-Linked Bond 1-5 Year Index (USD Hedged) handelt es sich um einen Index, der die Wertentwicklung der weltweiten Märkte für inflationsgekoppelte Staatsanleihen mit einer Laufzeit von mindestens 1 Jahr und weniger als 5 Jahren misst. In einen nicht gemanagten Index kann man nicht direkt anlegen.
Canadian Overnight Repo Rate (CORRA)	Mit dem Canadian Overnight Repo Rate (CORRA) werden die Finanzierungskosten von allgemeinen Übernacht-Sicherheiten in kanadischen Dollar gemessen, wobei Staatsanleihen und Anleihen der kanadischen Regierung als Sicherheit für Pensionsgeschäfte eingesetzt werden.
Euro Short-Term Rate (ESTER) Index	ESTER spiegelt die Kosten für unbesicherte Euro-Übernachtkredite von Banken im Euroraum wider. ESTER wird an jedem Tag veröffentlicht, an dem das Trans-European Automated Real-time Gross Settlement Express Transfer-Zahlungssystem (oder ein Nachfolgesystem) für die Abwicklung von Zahlungen in Euro geöffnet ist. ESTER beruht auf Transaktionen, die am vorangegangenen Geschäftstag (dem Stichtag „T“) mit einer Fälligkeit von T+1 durchgeführt und abgewickelt wurden und von denen angenommen wird, dass sie zu marktüblichen Bedingungen ausgeführt wurden, so dass sie die Marktzinsen unverzerrt widerspiegeln.
FTSE 3-Month Treasury Bill Index	Bei dem FTSE 3-Month Treasury Bill Index handelt es sich um einen nicht verwalteten Index, der die monatliche Ertrags-Äquivalente der Renditedurchschnitte der US-Schatzwechselemissionen der vergangenen drei Monate repräsentiert. In einen nicht gemanagten Index kann man nicht direkt anlegen.
FTSE Euro Broad Investment-Grade Index	Bei dem FTSE Euro Broad Investment Grade Index handelt es sich um einen Index des auf Euro basierenden Rentenmarkts der Kategorie Investment Grade, der institutionellen Anlegern (in Euro) zugänglich ist. In einen nicht gemanagten Index kann man nicht direkt anlegen.
ICE BofA Merrill Lynch 1-3 Year U.S. Treasury Index	Bei dem ICE BofA Merrill Lynch 1-3 Year US Treasury Index handelt es sich um einen nicht verwalteten Index, der US Treasuries (ausgenommen inflationsbesicherte Wertpapiere und STRIPS) mit mindestens 1 Milliarde USD umlaufendem Nennwert und einer Restlaufzeit bis zur endgültigen Fälligkeit von mindestens einem und weniger als drei Jahren enthält. In einen nicht gemanagten Index kann man nicht direkt anlegen.
ICE BofA Merrill Lynch 3-Month Treasury Bill Index (EUR Hedged)	Der ICE BofA Merrill Lynch 3-Month US Treasury Bill Index (EUR Hedged) umfasst eine einzige Emission, die zu Monatsbeginn gekauft und für einen vollen Monat gehalten wird. Am Monatsende wird diese Emission verkauft und in eine neu ausgewählte Emission angelegt. Die bei der Neugewichtung am Monatsende jeweils gewählte Emission ist der ausstehende Schatzwechsel, dessen Fälligkeitstermin am nächsten am Datum der Neugewichtung liegt, wobei er jedoch nicht mehr als drei Monate nach diesem Datum liegen darf. Um für die Wahl berücksichtigt zu werden, muss eine Emission am oder vor dem Neugewichtungsdatum am Monatsende abgewickelt worden sein. Der Index hält zwar oft den im Rahmen der jüngsten 3-Monats-Auktion ausgegebenen Schatzwechsel, es kann jedoch auch ein älterer 6-Monats-Wechsel gewählt werden.

Offizieller Name des Vergleichsindex	Beschreibung des Index
ICE BofA Merrill Lynch BB-B European Currency High Yield Constrained Index	Der Index ist so konzipiert, dass er die Wertentwicklung von auf EUR und GBP lautenden Unternehmensanleihen mit einem Rating unterhalb von Investment Grade abbildet, die auf den Eurobond-, GBP- oder EUR-Inlandsmärkten öffentlich begeben wurden. Um für eine Aufnahme in den Index in Frage zu kommen, müssen die Anleihen über eine Bewertung unter Investment Grade, jedoch mindestens über eine Einstufung von B3 basierend auf einem Durchschnitt aus Moody's, S&P sowie Fitch verfügen. Das Engagement gegenüber einzelnen Emittenten im Index ist auf 3 % beschränkt. Nähere Einzelheiten zum Index, einschließlich einer aktuellen Beschreibung seiner Duration, sind auf Anfrage von der Anlageberatungsgesellschaft erhältlich.
ICE BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index Hedged into USD	Der ICE BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index Hedged into USD bildet die Wertentwicklung von Anleihen mit einer schlechteren Einstufung als Investment Grade der Emittenten von Industrieschuldverschreibungen nach, die ihren Firmensitz in Industrieländern haben, die über eine erstklassige Bewertung ausländischer langfristiger Währungsverbindlichkeiten verfügen (basierend auf einer Kombination aus Moody's, S&P sowie Fitch). Der Index beinhaltet auf US-Dollar, kanadische Dollar, Pfund Sterling und Euro (oder eine Euro-Vorgänger-Währung) lautende Anleihen, schließt jedoch alle auf mehrere Währungen lautenden Anleihen aus. Die Anleihen müssen über eine Bewertung unter Investment Grade, jedoch mindestens über eine Einstufung von B3 basierend auf einer Kombination aus Moody's, S&P, sowie Fitch verfügen. Qualifizierte Anleihen müssen kapitalisierungsgewichtet sein, wobei die Gesamtallokation für einen einzelnen Emittenten (vorgegeben durch Bloomberg Tickers) unter 2 % liegen muss. Emittenten mit einem Anteil über dem Schwellenwert werden auf 2 % reduziert, und der Nennwert jeder einzelnen ihrer Anleihen wird proportional angepasst. Ebenso erhöht sich der Nennwert von Anleihen aller sonstigen Emittenten unter der 2 %-Deckelung entsprechend proportional. Vor dem 25. September 2009 waren die ICE BofA Merrill Lynch-Indizes als Merrill-Lynch-Indizes bekannt.
ICE BofA Merrill Lynch Sterling Non-Gilts 10+ Index	Der ICE BofA Merrill Lynch Sterling Non-Gilts 10+ Index besteht aus auf Pfund Sterling lautenden Anleihen der Kategorie Investment Grade; ausgenommen sind auf Sterling lautende, von der britischen Regierung begebene Anleihen. Alle im Index vertretenen Anleihen müssen von mindestens einer der großen Ratingagenturen als Anlagen von Investment-Grade eingestuft werden. In einen nicht gemanagten Index kann man nicht direkt anlegen.
ICE BofA Merrill Lynch Sterling Non-Gilts Index	Der ICE BofA Merrill Lynch Sterling Non-Gilts Index bildet die Wertentwicklung von auf Pfund Sterling lautenden erstklassigen öffentlichen Schuldtiteln von Unternehmens- und quasistaatlichen Emittenten sowie Emittenten außerhalb des Vereinigten Königreichs ab. In einen nicht gemanagten Index kann man nicht direkt anlegen.
ICE BofA Merrill Lynch U.S. High Yield Constrained Index	Der ICE BofA Merrill Lynch US High Yield Constrained Index bildet die Wertentwicklung von auf US-Dollar lautenden Unternehmensanleihen mit einer schlechteren Einstufung als Investment Grade ab, die am US-Inlandsmarkt öffentlich emittiert werden. Um für eine Aufnahme in den Index in Frage zu kommen, müssen Wertpapiere über ein Rating unterhalb von Investment Grade (basierend auf dem Durchschnitt von Moody's, S&P sowie Fitch) und ein Risikoland mit Investment Grade-Rating (basierend auf dem Durchschnitt von Moody's, S&P sowie Fitch für auf Fremdwährung lautende Staatsanleihen mit langer Laufzeit) verfügen.
ICE BofA SARON Overnight Rate Index	Der ICE BofA SARON Overnight Rate Index bildet die Wertentwicklung eines synthetischen Vermögenswerts nach, der SORAN bis zu einer angegebenen Laufzeit zahlt. Der Index basiert auf dem angenommenen Kauf eines synthetischen Instruments zum Nennwert mit genau der angegebenen Laufzeit und einem Kupon in Höhe des Fixing-Kurses dieses Tages. Es wird davon ausgegangen, dass diese Emission am folgenden Geschäftstag verkauft (mit einer Rendite, die dem Fixing-Kurs des aktuellen Tages entspricht) und in ein neues Instrument übertragen wird.
ICE BofA SOFR Overnight Rate Index	Der ICE BofA SOFR Overnight Rate Index bildet die Wertentwicklung eines synthetischen Vermögenswerts nach, der SOFR bis zu einer angegebenen Laufzeit zahlt. Der Index basiert auf dem angenommenen Kauf eines synthetischen Instruments zum Nennwert mit genau der angegebenen Laufzeit und einem Kupon in Höhe des Fixing-Kurses dieses Tages. Es wird davon ausgegangen, dass diese Emission am folgenden Geschäftstag verkauft (mit einer Rendite, die dem Fixing-Kurs des aktuellen Tages entspricht) und in ein neues Instrument übertragen wird. In einen nicht gemanagten Index kann man nicht direkt anlegen.
ICE BofA SONIA Overnight Rate Index	Der ICE BofA SONIA Overnight Rate Index bildet die Wertentwicklung eines synthetischen Vermögenswerts nach, der SONIA bis zu einer angegebenen Laufzeit zahlt. Der Index basiert auf dem angenommenen Kauf eines synthetischen Instruments zum Nennwert mit genau der angegebenen Laufzeit und einem Kupon in Höhe des Fixing-Kurses dieses Tages. Es wird davon ausgegangen, dass diese Emission am folgenden Geschäftstag verkauft (mit einer Rendite, die dem Fixing-Kurs des aktuellen Tages entspricht) und in ein neues Instrument übertragen wird.
JPMorgan Asia Credit Index	Mit dem JPMorgan Asia Credit Index wird die Wertentwicklung des asiatischen Marktes für auf USD lautende Anleihen ohne Japan gemessen. Der Index bietet eine Vergleichsindex für Anlagemöglichkeiten in auf US-Dollar lautenden festverzinslichen Anlagen, die von staatlichen, quasi-staatlichen und halbstaatlichen Emittenten aus Asien (ohne Japan) begeben werden.
JPMorgan Corporate Emerging Markets Bond Index Diversified (CEMBI)	Bei dem JPMorgan Corporate Emerging Markets Bond Index Diversified (CEMBI) handelt es sich um eine besondere, gewichtete Version des CEMBI-Index. Er beschränkt den Anteil der Indexländer mit umfangreicheren Industrieschuldverschreibungen, indem er nur einen bestimmten Anteil des aktuell bankfähigen Nennwerts der Schulden dieser Länder einbezieht. Der CEMBI Diversified führt zu gut verteilten, ausgeglicheneren Gewichtungen für die im Index enthaltenen Länder. Die vom CEMBI Diversified abgedeckten Länder sind mit den vom CEMBI abgedeckten identisch. In einen nicht gemanagten Index kann man nicht direkt anlegen.
JPMorgan Emerging Local Markets Index Plus (Unhedged)	Der JPMorgan Emerging Local Markets Index Plus (Unhedged) bildet die Gesamterträge für auf lokale Währungen lautende Geldmarktinstrumente in 22 Schwellenmarktländern mit mindestens 10 Milliarden USD Außenhandel nach. In einen nicht gemanagten Index kann man nicht direkt anlegen.
JPMorgan Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global	Der JPMorgan Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global bildet die Gesamterträge der auf US-Dollar lautenden Schuldinstrumente ab, die von staatlichen sowie quasi-staatlichen Körperschaften aus Schwellenländern ausgegeben wurden.
JPMorgan ESG Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global Diversified	Der JPMorgan ESG Emerging Markets Bond Index Global Diversified bildet die Gesamtrenditen von auf US-Dollar lautenden Schuldinstrumenten nach, die von staatlichen und quasi-staatlichen Emittenten aus Schwellenländern begeben werden und die Umwelt-, Sozial- und Unternehmensführungsfaktoren in die Indexaufbau einbeziehen.

Beschreibungen der Vergleichsindizes (Forts.)

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

(Diese Seite wurde absichtlich freigelassen.)

Finanzstatus

(Angaben in Tausend)	PIMCO Asia High Yield Bond Fund		Asia Strategic Interest Bond Fund	
	Zum 30. Jun. 2023	Zum 31. Dez. 2022	Zum 30. Jun. 2023	Zum 31. Dez. 2022
Aktiva:				
Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertetes Finanzvermögen:				
Übertragbare Wertpapiere	$ 2.458.996	$ 2.652.171	$ 281.696	$ 276.959
Investmentfonds	271.904	239.979	20.835	29.746
Pensionsgeschäfte	7.016	20.572	347	820
Einlagen bei Kreditinstituten	0	0	0	0
Finanzderivate	32.729	54.267	3.452	3.700
Zahlungsmittel	2.118	0	511	546
Einlagen bei Kontrahenten	23.599	34.314	2.463	2.017
Forderungen aus Einkünften	47.232	48.231	4.467	3.836
Forderungen aus verkauften Anlagen	0	18.600	9.689	0
Forderungen aus verkauften TBA-Anlagen	0	0	0	0
Forderungen aus verkauften Fondsanteilen	38	5.111	71	119
Forderungen aus Derivate-Gewinnen	19.571	14.965	2.203	1.946
Sonstige Aktiva	0	0	0	0
Summe Aktiva	2.863.203	3.088.210	325.734	319.689
Passiva:				
Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete Finanzverbindlichkeiten:				
Finanzderivate	(15.108)	(27.401)	(1.473)	(1.065)
Zeitwert der leerverkauften Wertpapiere	0	0	0	0
Verbindlichkeiten aus erworbenen Anlagen	(9.208)	(3.578)	(500)	0
Verbindlichkeiten aus erworbenen TBA-Anlagen	0	0	0	0
Verbindlichkeiten aus Fondsrücknahmen	(5.497)	(11.061)	(89)	(76)
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühr	(1.533)	(1.671)	(168)	(164)
Verbindlichkeiten aus Pensionsgeschäften	0	0	0	0
Zahlbar für Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte	0	0	0	0
Verbindlichkeiten aus Aufwendungen	(31)	(41)	0	0
Überziehungskredit	0	(13.527)	0	0
Zu zahlende Dividende	(186)	(161)	(1)	0
Verbindlichkeiten aus Derivatemargen	(26.849)	(25.632)	(1.658)	(1.842)
Einlagen von Kontrahenten	(8.620)	(23.746)	(2.026)	(2.555)
Sonstige Verbindlichkeiten	0	0	0	0
Summe Passiva ohne Nettovermögen der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber	(67.032)	(106.818)	(5.915)	(5.702)
Nettovermögen der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber	$ 2.796.171	$ 2.981.392	$ 319.819	$ 313.987

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

PIMCO Capital Securities Fund		PIMCO Climate Bond Fund		Commodity Real Return Fund		PIMCO Credit Opportunities Bond Fund	
Zum 30. Jun. 2023	Zum 31. Dez. 2022	Zum 30. Jun. 2023	Zum 31. Dez. 2022	Zum 30. Jun. 2023	Zum 31. Dez. 2022	Zum 30. Jun. 2023	Zum 31. Dez. 2022
$ 5.571.381	$ 6.129.600	$ 249.473	$ 248.281	$ 1.389.961	$ 1.750.918	$ 90.030	$ 80.195
142	140	0	0	123	120	9.730	9.649
25.100	10.172	34.000	36.800	2.394	59.113	13.153	6.910
0	0	0	0	0	0	0	0
76.310	107.561	7.671	8.236	30.742	45.313	2.113	2.563
753	2.624	1.803	1.484	3.138	4.491	181	177
74.364	110.882	3.962	8.041	50.334	39.055	1.687	1.533
52.834	66.969	2.397	2.192	4.373	4.250	877	1.002
10.122	33.701	0	0	251	50.448	6	206
0	0	0	0	89.717	206.413	17.215	1.296
1.327	3.060	111	363	722	5.062	37	138
29.148	54.526	2.233	1.167	5.966	17.822	254	1.075
0	0	0	0	0	0	0	0
5.841.481	6.519.235	301.650	306.564	1.577.721	2.183.005	135.283	104.744
(86.968)	(86.485)	(3.233)	(5.599)	(50.389)	(50.044)	(1.132)	(2.137)
0	0	0	0	0	0	0	0
(2.600)	(1)	(544)	0	0	0	(300)	(304)
0	0	0	0	(179.499)	(288.321)	(32.545)	(3.587)
(2.370)	(7.922)	(2.263)	(193)	(4.480)	(3.460)	(51)	(50)
(4.402)	(4.729)	(138)	(145)	(870)	(1.261)	(87)	(89)
(253.383)	(578.475)	0	0	(339.254)	(425.302)	0	0
0	0	0	0	(23.081)	(17.959)	0	0
(203)	(237)	(7)	(24)	(9)	(15)	0	0
0	0	0	0	0	0	0	0
(1.217)	(906)	(372)	(157)	(285)	(336)	0	0
(16.273)	(77.568)	(179)	(3.321)	(4.962)	(18.239)	(1.062)	(833)
(24.063)	(41.321)	(5.390)	(4.470)	(1.726)	(8.191)	(310)	(591)
0	0	0	0	0	0	0	0
(391.479)	(797.644)	(12.126)	(13.909)	(604.555)	(813.128)	(35.487)	(7.591)
$ 5.450.002	$ 5.721.591	$ 289.524	$ 292.655	$ 973.166	$ 1.369.877	$ 99.796	$ 97.153

Aufstellung der Aktiva und Passiva (Forts.)

(Angaben in Tausend)	Diversified Income Fund		Diversified Income Duration Hedged Fund	
	Zum 30. Jun. 2023	Zum 31. Dez. 2022	Zum 30. Jun. 2023	Zum 31. Dez. 2022
Aktiva:				
Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertetes Finanzvermögen:				
Übertragbare Wertpapiere	$ 6.106.201	$ 6.620.617	$ 359.563	$ 401.584
Investmentfonds	795.982	876.630	51.387	55.806
Pensionsgeschäfte	1.236.637	1.746.323	107.366	102.832
Einlagen bei Kreditinstituten	0	0	0	0
Finanzderivate	152.168	132.621	31.613	19.178
Zahlungsmittel	2.539	0	65	513
Einlagen bei Kontrahenten	212.801	282.594	28.166	20.323
Forderungen aus Einkünften	82.191	83.844	4.825	5.122
Forderungen aus verkauften Anlagen	36.373	51.445	1.251	1.998
Forderungen aus verkauften TBA-Anlagen	403.838	248.272	23.627	19.854
Forderungen aus verkauften Fondsanteilen	6.266	5.685	39	98
Forderungen aus Derivate-Gewinnen	95.166	113.759	21.012	19.031
Sonstige Aktiva	0	0	0	0
Summe Aktiva	9.130.162	10.161.790	628.914	646.339
Passiva:				
Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete Finanzverbindlichkeiten:				
Finanzderivate	(151.381)	(150.759)	(8.987)	(5.030)
Zeitwert der leerverkauften Wertpapiere	0	0	0	0
Verbindlichkeiten aus erworbenen Anlagen	(8.728)	(586.220)	0	(940)
Verbindlichkeiten aus erworbenen TBA-Anlagen	(868.173)	(549.539)	(53.598)	(39.365)
Verbindlichkeiten aus Fondsrücknahmen	(5.225)	(7.240)	(205)	(2.623)
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühr	(6.860)	(8.022)	(381)	(438)
Verbindlichkeiten aus Pensionsgeschäften	(63.195)	(6.646)	(368)	0
Zahlbar für Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte	0	0	0	0
Verbindlichkeiten aus Aufwendungen	(148)	(148)	(1)	(2)
Überziehungskredit	0	(3.465)	0	0
Zu zahlende Dividende	(5.802)	(3.841)	(1.408)	(870)
Verbindlichkeiten aus Derivatemargen	(34.281)	(62.209)	(35.405)	(29.190)
Einlagen von Kontrahenten	(43.652)	(31.905)	(6.994)	(3.197)
Sonstige Verbindlichkeiten	0	0	0	0
Summe Passiva ohne Nettovermögen der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber	(1.187.445)	(1.409.994)	(107.347)	(81.655)
Nettovermögen der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber	$ 7.942.717	$ 8.751.796	$ 521.567	$ 564.684

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

Diversified Income ESG Fund		Dynamic Bond Fund		Dynamic Multi-Asset Fund		Emerging Local Bond Fund	
Zum 30. Jun. 2023	Zum 31. Dez. 2022	Zum 30. Jun. 2023	Zum 31. Dez. 2022	Zum 30. Jun. 2023	Zum 31. Dez. 2022	Zum 30. Jun. 2023	Zum 31. Dez. 2022
$ 44.287	$ 9.978	$ 3.011.520	$ 2.712.201	€ 4.246.875	€ 4.130.924	$ 2.549.023	$ 1.772.984
5.064	0	336.750	348.722	419.861	504.414	269.736	131.643
7.400	0	555.858	1.145.692	329.566	124.604	0	0
0	0	0	0	0	0	19.027	7.054
1.079	60	144.276	74.933	117.828	234.476	139.995	315.328
509	108	6.281	7.730	13.209	38.251	38.890	35.990
695	113	71.278	96.997	169.395	395.426	46.277	51.091
610	112	17.860	16.752	18.832	5.003	50.874	35.522
0	0	12.924	7.837	1.663	9.331	1.618	26.063
197	603	689.297	454.635	592.089	0	0	0
0	0	1.939	2.056	1.137	2.321	3.236	4.086
37	27	51.889	69.677	88.263	165.342	41.366	102.125
0	0	0	0	0	0	0	17
59.878	11.001	4.899.872	4.937.232	5.998.718	5.610.092	3.160.042	2.481.903
(1.391)	(73)	(121.129)	(160.788)	(98.515)	(236.948)	(125.287)	(313.285)
0	0	(82.313)	(82.152)	0	0	0	0
0	0	(1.263)	(557.164)	0	(21.731)	(26.546)	(28.070)
(396)	(1.000)	(1.246.477)	(607.223)	(1.520.012)	0	0	0
(43)	0	(1.993)	(600)	(12.243)	(13.813)	(399)	(665)
(34)	(6)	(2.661)	(2.772)	(4.392)	(5.575)	(2.131)	(1.496)
0	0	(217)	(2.164)	0	(17.828)	(150.013)	(85.313)
0	0	0	0	0	0	0	0
(1)	0	(64)	(68)	(30)	(33)	(611)	(206)
0	0	0	0	0	0	0	0
0	0	(1.234)	(680)	(319)	0	0	0
(14)	(68)	(14.522)	(28.530)	(47.082)	(115.772)	(23.381)	(83.123)
(10)	0	(60.706)	(11.490)	(57.914)	(83.222)	(46.231)	(50.077)
0	0	0	0	0	0	0	0
(1.889)	(1.147)	(1.532.579)	(1.453.631)	(1.740.507)	(494.922)	(374.599)	(562.235)
$ 57.989	$ 9.854	$ 3.367.293	$ 3.483.601	€ 4.258.211	€ 5.115.170	$ 2.785.443	$ 1.919.668

Aufstellung der Aktiva und Passiva (Forts.)

(Angaben in Tausend)	Emerging Local Bond ESG Fund Zum 30. Jun. 2023	Emerging Local Bond ESG Fund Zum 31. Dez. 2022	Emerging Markets Bond Fund Zum 30. Jun. 2023	Emerging Markets Bond Fund Zum 31. Dez. 2022
Aktiva:				
Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertetes Finanzvermögen:				
Übertragbare Wertpapiere	$ 7.580	$ 6.270	$ 3.348.247	$ 3.267.661
Investmentfonds	0	0	30.285	52.797
Pensionsgeschäfte	0	0	0	9.160
Einlagen bei Kreditinstituten	54	4	24.740	2.227
Finanzderivate	229	269	76.871	69.071
Zahlungsmittel	143	127	6.357	4.943
Einlagen bei Kontrahenten	60	39	22.310	49.025
Forderungen aus Einkünften	135	122	59.573	52.462
Forderungen aus verkauften Anlagen	0	0	9.003	400
Forderungen aus verkauften TBA-Anlagen	0	0	34.093	26.106
Forderungen aus verkauften Fondsanteilen	0	0	4.214	714
Forderungen aus Derivate-Gewinnen	30	11	16.555	25.590
Sonstige Aktiva	0	0	0	0
Summe Aktiva	8.231	6.842	3.632.248	3.560.156
Passiva:				
Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete Finanzverbindlichkeiten:				
Finanzderivate	(210)	(215)	(48.881)	(49.305)
Zeitwert der leerverkauften Wertpapiere	0	0	0	0
Verbindlichkeiten aus erworbenen Anlagen	(126)	0	(37.127)	(10.331)
Verbindlichkeiten aus erworbenen TBA-Anlagen	0	0	(58.022)	(49.405)
Verbindlichkeiten aus Fondsrücknahmen	0	0	(4.783)	(13.371)
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühr	(4)	(4)	(2.440)	(2.521)
Verbindlichkeiten aus Pensionsgeschäften	(110)	0	(54.912)	(75.356)
Zahlbar für Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte	0	0	0	0
Verbindlichkeiten aus Aufwendungen	(10)	(2)	(15)	(12)
Überziehungskredit	0	0	0	0
Zu zahlende Dividende	0	0	(280)	(276)
Verbindlichkeiten aus Derivatemargen	(19)	(12)	(4.716)	(15.372)
Einlagen von Kontrahenten	(60)	0	(31.425)	(38.228)
Sonstige Verbindlichkeiten	0	0	0	0
Summe Passiva ohne Nettovermögen der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber	(539)	(233)	(242.601)	(254.177)
Nettovermögen der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber	$ 7.692	$ 6.609	$ 3.389.647	$ 3.305.979

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

Emerging Markets Bond ESG Fund		Emerging Markets Corporate Bond Fund		PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund		Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund	
Zum 30. Jun. 2023	Zum 31. Dez. 2022	Zum 30. Jun. 2023	Zum 31. Dez. 2022	Zum 30. Jun. 2023	Zum 31. Dez. 2022	Zum 30. Jun. 2023	Zum 31. Dez. 2022
$ 2.242.384	$ 2.422.256	$ 138.695	$ 143.387	$ 205.639	$ 181.600	$ 17.353	$ 15.264
0	0	15.721	16.518	12.618	14.797	1.960	2.058
90.940	44.661	3.949	8.386	939	706	150	2.766
17.905	1.659	1.140	0	1.619	137	153	78
61.429	56.599	3.855	4.439	31.819	34.841	1.329	4.060
1.589	2.605	231	262	190	1.447	94	185
20.189	25.425	1.722	1.839	9.662	10.495	273	282
33.927	37.299	1.933	1.915	2.286	1.549	126	87
37.854	215	466	1	19.074	207	5	1
3.487	4.814	2.559	1.285	0	0	0	0
10.806	10.705	0	55	3	0	10	11
9.457	10.516	1.704	984	7.351	5.129	106	254
0	0	0	0	0	0	0	0
2.529.967	2.616.754	171.975	179.071	291.200	250.908	21.559	25.046
(33.210)	(23.713)	(1.644)	(618)	(24.089)	(31.528)	(946)	(3.067)
(551)	0	0	0	0	0	0	0
(49.523)	(3.745)	(1.192)	(2.163)	(19.808)	0	0	(109)
(6.478)	(7.710)	(5.626)	(2.563)	0	0	0	0
(2.617)	(461)	(60)	(10)	(15)	(586)	(11)	(5)
(1.746)	(1.929)	(161)	(172)	(85)	(64)	(23)	(25)
(36.961)	(38.840)	0	0	0	0	0	0
0	0	0	0	0	0	0	0
(1)	(1)	0	0	0	(8)	0	(1)
0	0	0	0	0	0	0	0
(1.780)	(2.167)	0	0	0	0	0	0
(5.266)	(9.012)	(1.696)	(1.872)	(11.195)	(10.037)	(225)	(631)
(29.501)	(36.701)	(1.863)	(2.687)	(5.440)	(3.554)	(271)	(271)
0	0	0	0	0	0	0	0
(167.634)	(124.279)	(12.242)	(10.085)	(60.632)	(45.777)	(1.476)	(4.109)
$ 2.362.333	$ 2.492.475	$ 159.733	$ 168.986	$ 230.568	$ 205.131	$ 20.083	$ 20.937

Aufstellung der Aktiva und Passiva (Forts.)

(Angaben in Tausend)	PIMCO ESG Income Fund Zum 30. Jun. 2023	PIMCO ESG Income Fund Zum 31. Dez. 2022	Euro Bond Fund Zum 30. Jun. 2023	Euro Bond Fund Zum 31. Dez. 2022
Aktiva:				
Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertetes Finanzvermögen:				
Übertragbare Wertpapiere	$ 316.722	$ 254.108	€ 1.600.490	€ 1.747.790
Investmentfonds	0	0	132.603	181.654
Pensionsgeschäfte	31.800	44.400	104.244	11.515
Einlagen bei Kreditinstituten	0	0	0	0
Finanzderivate	6.458	5.555	34.165	49.805
Zahlungsmittel	850	1.533	4.760	3.052
Einlagen bei Kontrahenten	4.337	2.737	51.066	59.589
Forderungen aus Einkünften	1.664	1.372	8.624	8.903
Forderungen aus verkauften Anlagen	349	80	2.764	13.467
Forderungen aus verkauften TBA-Anlagen	80.076	78.252	201.972	168.280
Forderungen aus verkauften Fondsanteilen	676	221	208	932
Forderungen aus Derivate-Gewinnen	4.896	4.814	21.575	105.486
Sonstige Aktiva	0	0	0	0
Summe Aktiva	447.828	393.072	2.162.471	2.350.473
Passiva:				
Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete Finanzverbindlichkeiten:				
Finanzderivate	(6.257)	(4.277)	(34.899)	(122.819)
Zeitwert der leerverkauften Wertpapiere	(441)	(2.630)	0	0
Verbindlichkeiten aus erworbenen Anlagen	(22.288)	(707)	0	(95)
Verbindlichkeiten aus erworbenen TBA-Anlagen	(157.506)	(141.114)	(344.659)	(264.938)
Verbindlichkeiten aus Fondsrücknahmen	(101)	(12)	(648)	(405)
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühr	(134)	(118)	(768)	(807)
Verbindlichkeiten aus Pensionsgeschäften	0	0	0	0
Zahlbar für Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte	0	0	0	0
Verbindlichkeiten aus Aufwendungen	(10)	(12)	(5)	(5)
Überziehungskredit	0	0	0	0
Zu zahlende Dividende	(1)	(1)	0	0
Verbindlichkeiten aus Derivatemargen	(2.431)	(3.190)	(12.388)	(41.188)
Einlagen von Kontrahenten	(3.967)	(3.050)	(15.543)	(6.941)
Sonstige Verbindlichkeiten	0	0	0	0
Summe Passiva ohne Nettovermögen der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber	(193.136)	(155.111)	(408.910)	(437.198)
Nettovermögen der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber	$ 254.692	$ 237.961	€ 1.753.561	€ 1.913.275

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

Euro Credit Fund		Euro Income Bond Fund		Euro Long Average Duration Fund		Euro Short-Term Fund	
Zum 30. Jun. 2023	Zum 31. Dez. 2022	Zum 30. Jun. 2023	Zum 31. Dez. 2022	Zum 30. Jun. 2023	Zum 31. Dez. 2022	Zum 30. Jun. 2023	Zum 31. Dez. 2022
€ 528.695	€ 491.678	€ 1.389.763	€ 1.100.441	€ 441.943	€ 103.959	€ 199.083	€ 330.698
51.452	50.689	124.045	134.815	11.160	4.940	0	0
28.577	44.621	122.674	120.458	7.333	1.500	9.531	14.100
0	0	0	0	0	0	0	0
8.106	9.083	33.023	26.003	1.386	3.789	3.282	5.409
3.510	12.028	10.479	7.361	278	397	395	896
10.762	26.366	48.778	47.460	6.017	4.382	4.613	6.396
4.409	4.187	7.767	8.869	3.284	1.039	862	1.735
6.412	2.447	5.106	53.521	0	0	0	63
19.416	1.073	550.730	117.074	10.758	6.332	0	0
174	242	3.708	1.107	155.112	51	35	550
6.051	33.489	18.857	19.325	1.238	16.625	407	5.754
0	0	0	0	0	0	0	0
667.564	675.903	2.314.930	1.636.434	638.509	143.014	218.208	365.601
(3.786)	(13.081)	(29.615)	(27.457)	(1.023)	(18.830)	(1.162)	(2.312)
0	0	0	0	0	0	0	0
(11.362)	(7.404)	(3.667)	(22.578)	(138.012)	0	0	0
(31.466)	(13.488)	(984.881)	(208.728)	(47.356)	(11.721)	0	0
(30)	(85)	(1.480)	(1.033)	(129)	0	(1.223)	(1.514)
(233)	(252)	(1.149)	(1.244)	(49)	(46)	(61)	(105)
(549)	0	(8.856)	0	0	0	0	0
0	0	0	0	0	0	0	0
0	0	(17)	(17)	0	0	0	0
0	0	0	0	0	0	0	0
0	0	0	0	0	0	0	0
(9.188)	(29.619)	(9.312)	(18.036)	(1.975)	(2.369)	(1.463)	(6.452)
(1.011)	(1.966)	(13.783)	(4.361)	0	0	(940)	(2.123)
0	0	0	0	0	0	0	0
(57.625)	(65.895)	(1.052.760)	(283.454)	(188.544)	(32.966)	(4.849)	(12.506)
€ 609.939	€ 610.008	€ 1.262.170	€ 1.352.980	€ 449.965	€ 110.048	€ 213.359	€ 353.095

Aufstellung der Aktiva und Passiva (Forts.)

(Angaben in Tausend)	PIMCO European High Yield Bond Fund Zum 30. Jun. 2023	PIMCO European High Yield Bond Fund Zum 31. Dez. 2022	PIMCO European Short-Term Opportunities Fund Zum 30. Jun. 2023	PIMCO European Short-Term Opportunities Fund Zum 31. Dez. 2022
Aktiva:				
Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertetes Finanzvermögen:				
Übertragbare Wertpapiere	€ 203.864	€ 157.222	€ 145.291	€ 193.346
Investmentfonds	11.682	8.700	11.875	18.800
Pensionsgeschäfte	3.200	3.700	295	4.400
Einlagen bei Kreditinstituten	0	0	0	0
Finanzderivate	2.412	2.007	1.608	7.774
Zahlungsmittel	1.561	3.440	224	640
Einlagen bei Kontrahenten	4.006	2.986	2.542	4.772
Forderungen aus Einkünften	2.358	1.897	954	1.077
Forderungen aus verkauften Anlagen	1	32	2.489	1.622
Forderungen aus verkauften TBA-Anlagen	0	0	13.480	12.293
Forderungen aus verkauften Fondsanteilen	137	71	132	293
Forderungen aus Derivate-Gewinnen	1.253	1.485	3.078	4.861
Sonstige Aktiva	0	0	0	0
Summe Aktiva	230.474	181.540	181.968	249.878
Passiva:				
Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete Finanzverbindlichkeiten:				
Finanzderivate	(1.400)	(1.105)	(4.435)	(8.310)
Zeitwert der leerverkauften Wertpapiere	0	0	0	0
Verbindlichkeiten aus erworbenen Anlagen	(888)	(4.181)	(613)	(590)
Verbindlichkeiten aus erworbenen TBA-Anlagen	0	0	(27.026)	(23.393)
Verbindlichkeiten aus Fondsrücknahmen	(77)	(1)	(467)	(111)
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühr	(49)	(13)	(51)	(66)
Verbindlichkeiten aus Pensionsgeschäften	(837)	0	0	0
Zahlbar für Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte	0	0	0	0
Verbindlichkeiten aus Aufwendungen	0	0	0	0
Überziehungskredit	0	0	0	0
Zu zahlende Dividende	0	0	0	0
Verbindlichkeiten aus Derivatemargen	(2.280)	(2.078)	(671)	(5.044)
Einlagen von Kontrahenten	(270)	0	(827)	(1.192)
Sonstige Verbindlichkeiten	0	0	0	0
Summe Passiva ohne Nettovermögen der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber	(5.801)	(7.378)	(34.090)	(38.706)
Nettovermögen der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber	€ 224.673	€ 174.162	€ 147.878	€ 211.172

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

Global Advantage Fund		Global Bond Fund		Global Bond ESG Fund		Global Bond Ex-US Fund	
Zum 30. Jun. 2023	Zum 31. Dez. 2022	Zum 30. Jun. 2023	Zum 31. Dez. 2022	Zum 30. Jun. 2023	Zum 31. Dez. 2022	Zum 30. Jun. 2023	Zum 31. Dez. 2022
$ 518.780	$ 443.632	$ 14.608.940	$ 11.361.097	$ 3.663.093	$ 2.913.880	$ 880.157	$ 737.412
21.489	18.242	1.249.595	1.120.979	0	5.649	50.080	47.322
2.347	1.408	721.100	1.346.970	206.285	1.157.847	1.874	1.625
0	0	0	0	0	0	0	0
21.498	25.927	664.136	518.391	179.715	94.009	48.176	35.105
3.640	3.907	40.094	32.207	11.702	8.552	6.153	5.507
17.835	15.524	391.910	478.539	81.892	125.721	27.630	39.796
2.996	2.702	54.450	51.007	14.180	10.094	3.825	3.559
8.571	9.551	296.314	279.220	31.129	26.307	16.485	15.805
187.611	96.161	5.312.529	4.755.367	694.836	450.850	338.294	255.052
1	3	57.121	77.660	10.249	3.518	900	460
13.448	22.907	326.798	658.178	88.034	164.909	26.115	56.123
0	0	0	0	0	0	0	0
798.216	639.964	23.722.987	20.679.615	4.981.115	4.961.336	1.399.689	1.197.766
(23.470)	(21.316)	(570.797)	(859.558)	(88.084)	(151.501)	(36.366)	(63.177)
(28.873)	(28.813)	(722.957)	(721.316)	(124.257)	(119.122)	(78.766)	(76.200)
(8.453)	(8.457)	(297.938)	(930.760)	(42.977)	(622.586)	(15.636)	(15.641)
(310.625)	(140.479)	(9.067.703)	(6.231.107)	(1.205.227)	(792.022)	(497.245)	(282.153)
(6)	(35)	(22.823)	(13.836)	(3.872)	(10.843)	(385)	(75)
(241)	(250)	(6.072)	(5.736)	(1.366)	(1.314)	(330)	(342)
0	(1.504)	(1.895)	(1.682)	0	0	0	0
0	0	0	0	0	0	0	0
(26)	(17)	(173)	(137)	(3)	(3)	(6)	(7)
0	0	0	0	0	0	0	0
0	0	(922)	(736)	(1.740)	(399)	0	0
(11.607)	(23.802)	(168.589)	(407.767)	(68.428)	(125.388)	(24.910)	(41.421)
(3.300)	(4.832)	(251.408)	(86.868)	(100.327)	(31.968)	(15.469)	(2.728)
0	0	0	0	0	0	0	0
(386.601)	(229.505)	(11.111.277)	(9.259.503)	(1.636.281)	(1.855.146)	(669.113)	(481.744)
$ 411.615	$ 410.459	$ 12.611.710	$ 11.420.112	$ 3.344.834	$ 3.106.190	$ 730.576	$ 716.022

Aufstellung der Aktiva und Passiva (Forts.)

(Angaben in Tausend)	PIMCO Global Core Asset Allocation Fund		Global High Yield Bond Fund	
	Zum 30. Jun. 2023	Zum 31. Dez. 2022	Zum 30. Jun. 2023	Zum 31. Dez. 2022
Aktiva:				
Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertetes Finanzvermögen:				
Übertragbare Wertpapiere	$ 524.174	$ 473.435	$ 2.913.163	$ 2.850.786
Investmentfonds	236.945	251.489	130.837	201.583
Pensionsgeschäfte	18.513	18.536	3.895	11.412
Einlagen bei Kreditinstituten	0	0	0	0
Finanzderivate	41.444	29.087	36.787	36.885
Zahlungsmittel	3.006	12.189	1.899	26
Einlagen bei Kontrahenten	29.989	40.674	14.859	28.611
Forderungen aus Einkünften	2.518	1.307	40.703	40.375
Forderungen aus verkauften Anlagen	627	4.838	214	23
Forderungen aus verkauften TBA-Anlagen	118.316	90.163	0	0
Forderungen aus verkauften Fondsanteilen	376	270	3.600	7.615
Forderungen aus Derivate-Gewinnen	17.143	35.050	1.437	788
Sonstige Aktiva	0	0	30	223
Summe Aktiva	993.051	957.038	3.147.424	3.178.327
Passiva:				
Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete Finanzverbindlichkeiten:				
Finanzderivate	(16.921)	(43.855)	(20.345)	(20.824)
Zeitwert der leerverkauften Wertpapiere	0	0	0	0
Verbindlichkeiten aus erworbenen Anlagen	(13.091)	(1.870)	(20.661)	0
Verbindlichkeiten aus erworbenen TBA-Anlagen	(257.057)	(117.381)	0	0
Verbindlichkeiten aus Fondsrücknahmen	(526)	(10.695)	(3.938)	(13.817)
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühr	(747)	(793)	(1.829)	(1.960)
Verbindlichkeiten aus Pensionsgeschäften	0	0	(11.985)	(10.397)
Zahlbar für Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte	0	0	0	0
Verbindlichkeiten aus Aufwendungen	(3)	(3)	(25)	(123)
Überziehungskredit	0	0	0	0
Zu zahlende Dividende	(40)	(40)	(4.628)	(4.126)
Verbindlichkeiten aus Derivatemargen	(20.493)	(18.837)	(1.405)	(3.436)
Einlagen von Kontrahenten	(15.586)	(13.488)	(12.772)	(20.776)
Sonstige Verbindlichkeiten	0	0	0	0
Summe Passiva ohne Nettovermögen der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber	(324.464)	(206.962)	(77.588)	(75.459)
Nettovermögen der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber	$ 668.587	$ 750.076	$ 3.069.836	$ 3.102.868

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

Global Investment Grade Credit Fund		Global Investment Grade Credit ESG Fund		Global Low Duration Real Return Fund		Global Real Return Fund	
Zum 30. Jun. 2023	Zum 31. Dez. 2022	Zum 30. Jun. 2023	Zum 31. Dez. 2022	Zum 30. Jun. 2023	Zum 31. Dez. 2022	Zum 30. Jun. 2023	Zum 31. Dez. 2022
$ 9.186.690	$ 9.778.544	$ 2.107.775	$ 1.489.771	$ 1.697.365	$ 1.661.693	$ 3.401.577	$ 3.391.396
1.057.482	1.038.326	0	0	189	12.424	10.161	7.043
559.532	75.423	2.319	15.240	7.529	1.053	2.272	2.245
0	0	0	0	0	0	0	0
184.520	212.298	38.604	33.293	33.448	50.766	80.580	106.832
36.381	20.756	2.422	2.079	952	9.404	7.461	8.086
182.567	275.295	34.187	30.302	24.344	18.687	49.098	46.251
96.791	90.845	18.073	11.400	4.175	2.931	9.842	7.667
15.683	34.506	14.790	52.816	11.846	94.773	311	68.378
616.216	1.919.603	140.883	135.728	65.224	72.965	151.581	191.920
7.650	30.854	1.256	1.945	311	574	926	4.737
140.862	180.542	3.565	13.422	14.572	12.290	16.010	27.734
0	0	0	0	0	0	0	0
12.084.374	13.656.992	2.363.874	1.785.996	1.859.955	1.937.560	3.729.819	3.862.289
(202.313)	(293.790)	(21.813)	(17.969)	(30.763)	(29.733)	(74.956)	(93.426)
0	(136.255)	(31.398)	(5.887)	0	0	0	0
(23.751)	0	(3.691)	(8.117)	0	(30.524)	0	0
(1.235.486)	(2.481.720)	(287.441)	(202.456)	(130.717)	(132.585)	(303.432)	(325.573)
(14.213)	(32.381)	(518)	(188)	(2.188)	(2.607)	(2.782)	(3.628)
(5.637)	(5.738)	(826)	(605)	(686)	(735)	(1.339)	(1.447)
0	(4.154)	(151.412)	(75.928)	(408.892)	(261.713)	(791.310)	(796.152)
0	0	(30.833)	(75.925)	(9.212)	(79.599)	0	(9.519)
(299)	(339)	(137)	(124)	(2)	(2)	(41)	(51)
0	0	0	0	0	0	0	0
(8.969)	(6.988)	(1.221)	(692)	(1.752)	(446)	(6.199)	(2.363)
(69.607)	(82.017)	(4.982)	(13.852)	(13.375)	(18.182)	(21.429)	(35.345)
(31.248)	(75.269)	(10.253)	(14.363)	(9.211)	(17.059)	(17.662)	(22.923)
0	0	0	0	0	0	0	0
(1.591.523)	(3.118.651)	(544.525)	(416.106)	(606.798)	(573.185)	(1.219.150)	(1.290.427)
$ 10.492.851	$ 10.538.341	$ 1.819.349	$ 1.369.890	$ 1.253.157	$ 1.364.375	$ 2.510.669	$ 2.571.862

Aufstellung der Aktiva und Passiva (Forts.)

(Angaben in Tausend)	Income Fund Zum 30. Jun. 2023	Income Fund Zum 31. Dez. 2022	Income Fund II Zum 30. Jun. 2023	Income Fund II Zum 31. Dez. 2022
Aktiva:				
Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertetes Finanzvermögen:				
Übertragbare Wertpapiere	$ 79.018.485	$ 67.246.471	$ 94.891	$ 56.970
Investmentfonds	2.484.042	2.081.428	7.607	1.740
Pensionsgeschäfte	2.090.601	3.421.698	0	0
Einlagen bei Kreditinstituten	0	0	0	0
Finanzderivate	5.006.709	5.163.114	1.651	718
Zahlungsmittel	45.836	89.931	827	644
Einlagen bei Kontrahenten	1.978.585	1.852.978	1.682	1.022
Forderungen aus Einkünften	404.136	354.824	615	384
Forderungen aus verkauften Anlagen	64.631	60.282	4	5
Forderungen aus verkauften TBA-Anlagen	28.213.137	21.347.671	8.406	8.075
Forderungen aus verkauften Fondsanteilen	106.957	88.371	743	4.020
Forderungen aus Derivate-Gewinnen	1.569.675	1.235.828	889	637
Sonstige Aktiva	92	236	0	0
Summe Aktiva	120.982.886	102.942.832	117.315	74.215
Passiva:				
Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete Finanzverbindlichkeiten:				
Finanzderivate	(3.761.324)	(3.649.860)	(1.393)	(406)
Zeitwert der leerverkauften Wertpapiere	(70.650)	(734.103)	(378)	0
Verbindlichkeiten aus erworbenen Anlagen	(146.308)	(205.883)	0	(182)
Verbindlichkeiten aus erworbenen TBA-Anlagen	(49.488.695)	(37.310.306)	(16.684)	(15.917)
Verbindlichkeiten aus Fondsrücknahmen	(40.562)	(145.081)	(20)	0
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühr	(49.052)	(45.253)	(100)	(48)
Verbindlichkeiten aus Pensionsgeschäften	(8.320)	(15.867)	0	0
Zahlbar für Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte	0	0	0	0
Verbindlichkeiten aus Aufwendungen	(5.655)	(4.925)	0	0
Überziehungskredit	0	0	0	0
Zu zahlende Dividende	(3.122)	(2.737)	0	0
Verbindlichkeiten aus Derivatemargen	(2.452.308)	(2.473.835)	(761)	(1.036)
Einlagen von Kontrahenten	(429.323)	(374.655)	(260)	0
Sonstige Verbindlichkeiten	0	0	(2)	(3)
Summe Passiva ohne Nettovermögen der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber	(56.455.319)	(44.962.505)	(19.598)	(17.592)
Nettovermögen der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber	$ 64.527.567	$ 57.980.327	$ 97.717	$ 56.623

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

Inflation Multi-Asset Fund		Low Average Duration Fund		Low Duration Global Investment Grade Credit Fund		Low Duration Income Fund	
Zum 30. Jun. 2023	Zum 31. Dez. 2022	Zum 30. Jun. 2023	Zum 31. Dez. 2022	Zum 30. Jun. 2023	Zum 31. Dez. 2022	Zum 30. Jun. 2023	Zum 31. Dez. 2022
$ 293.906	$ 320.121	$ 1.153.664	$ 1.235.606	$ 821.335	$ 691.422	$ 1.708.028	$ 1.213.608
63.568	68.975	84.133	85.631	6.316	643	145.966	106.140
4.101	40.720	0	956	563	1.604	326.492	98.831
0	0	0	0	0	0	0	0
10.980	14.716	6.520	7.284	13.215	13.518	100.490	79.359
1.115	0	259	2.692	308	390	3.660	6.374
8.501	8.179	13.041	24.403	9.733	10.136	44.502	34.272
697	688	8.329	6.394	7.517	5.082	7.169	7.264
9	13	697	723	0	202	8.771	2.215
49.198	10.546	389.587	380.707	44.465	69.997	999.381	367.632
47	100	100	976	247	2.763	1.399	2.070
5.757	7.201	7.778	7.914	4.269	11.170	23.725	21.540
0	0	0	0	0	0	0	0
437.879	471.259	1.664.108	1.753.286	907.968	806.927	3.369.583	1.939.305
(11.987)	(10.695)	(12.193)	(14.403)	(8.857)	(11.395)	(62.272)	(64.082)
0	0	(49.879)	(76.949)	0	(14.029)	0	(5.209)
0	(2.206)	(39)	(2.924)	(2.499)	(1.062)	(9.143)	(9.219)
(92.814)	(43.111)	(466.010)	(427.587)	(89.713)	(97.540)	(1.778.081)	(724.143)
(1.057)	(1.769)	(2.697)	(1.987)	(1.045)	(422)	(550)	(185)
(339)	(445)	(409)	(495)	(348)	(289)	(719)	(565)
0	0	(221.985)	(144.857)	0	(12.776)	0	0
0	0	(19.674)	(4.077)	0	(1.409)	0	0
(3)	(5)	(9)	(10)	0	0	(24)	(24)
0	(980)	0	0	0	0	0	0
0	0	(27)	(13)	(41)	(20)	(547)	(247)
(4.797)	(6.644)	(1.876)	(3.315)	(1.852)	(4.014)	(42.165)	(28.430)
(2.704)	(2.326)	(3.298)	(3.911)	(5.396)	(9.222)	(20.697)	(22.821)
0	0	0	0	0	0	0	0
(113.701)	(68.181)	(778.096)	(680.528)	(109.751)	(152.178)	(1.914.198)	(854.925)
$ 324.178	$ 403.078	$ 886.012	$ 1.072.758	$ 798.217	$ 654.749	$ 1.455.385	$ 1.084.380

Aufstellung der Aktiva und Passiva (Forts.)

(Angaben in Tausend)	Low Duration Opportunities Fund Zum 30. Jun. 2023	Low Duration Opportunities Fund Zum 31. Dez. 2022	Low Duration Opportunities ESG Fund Zum 30. Jun. 2023	Low Duration Opportunities ESG Fund Zum 31. Dez. 2022
Aktiva:				
Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertetes Finanzvermögen:				
Übertragbare Wertpapiere	$ 1.055.335	$ 1.216.746	$ 5.400	$ 5.070
Investmentfonds	108.526	133.056	0	0
Pensionsgeschäfte	94.887	118.800	0	0
Einlagen bei Kreditinstituten	0	0	0	0
Finanzderivate	53.359	55.664	40	22
Zahlungsmittel	2.982	3.357	152	122
Einlagen bei Kontrahenten	36.099	57.806	50	31
Forderungen aus Einkünften	6.895	7.718	24	16
Forderungen aus verkauften Anlagen	6.071	12.795	49	0
Forderungen aus verkauften TBA-Anlagen	382.392	282.511	1.029	274
Forderungen aus verkauften Fondsanteilen	22	542	0	0
Forderungen aus Derivate-Gewinnen	27.076	45.871	34	51
Sonstige Aktiva	0	0	0	0
Summe Aktiva	1.773.644	1.934.866	6.778	5.586
Passiva:				
Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete Finanzverbindlichkeiten:				
Finanzderivate	(65.611)	(109.833)	(48)	(67)
Zeitwert der leerverkauften Wertpapiere	(45.584)	(94.108)	0	0
Verbindlichkeiten aus erworbenen Anlagen	(4.371)	(12.575)	0	0
Verbindlichkeiten aus erworbenen TBA-Anlagen	(517.783)	(347.541)	(1.694)	(545)
Verbindlichkeiten aus Fondsrücknahmen	(486)	(139)	0	0
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühr	(403)	(542)	(2)	(2)
Verbindlichkeiten aus Pensionsgeschäften	0	0	0	0
Zahlbar für Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte	0	0	0	0
Verbindlichkeiten aus Aufwendungen	(8)	(8)	0	0
Überziehungskredit	0	0	0	0
Zu zahlende Dividende	(996)	(1.377)	0	0
Verbindlichkeiten aus Derivatemargen	(6.836)	(19.443)	(17)	(44)
Einlagen von Kontrahenten	(10.189)	(3.519)	0	0
Sonstige Verbindlichkeiten	0	0	0	0
Summe Passiva ohne Nettovermögen der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber	(652.267)	(589.085)	(1.761)	(658)
Nettovermögen der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber	$ 1.121.377	$ 1.345.781	$ 5.017	$ 4.928

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

PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund		Mortgage Opportunities Fund		StocksPLUS™ Fund		PIMCO StocksPLUS™ AR Fund	
Zum 30. Jun. 2023	Zum 31. Dez. 2022	Zum 30. Jun. 2023	Zum 31. Dez. 2022	Zum 30. Jun. 2023	Zum 31. Dez. 2022	Zum 30. Jun. 2023	Zum 31. Dez. 2022
$ 86.230	$ 106.959	$ 1.421.861	$ 1.724.999	$ 1.011.424	$ 711.694	$ 7.486	$ 7.750
9.353	11.833	24	23	163.028	92.742	1.117	904
840	811	4.008	17.318	651.113	156.445	4.018	1.374
0	0	0	0	0	0	0	0
2.338	1.447	28.831	44.003	77.353	12.661	995	258
442	552	112	167	776	2.178	14	11
0	2.870	11.095	11.602	60.486	85.945	299	861
121	104	4.632	4.660	3.960	2.660	25	21
0	13	26.202	1.901	12	255	0	0
0	0	1.219.745	1.781.393	83.136	0	2.003	1.240
44	59	486	412	1.989	1.226	0	0
0	0	2.808	17.755	8.958	33.144	196	115
0	0	0	0	1	0	0	0
99.368	124.648	2.719.804	3.604.233	2.062.236	1.098.950	16.153	12.534
(357)	(237)	(12.291)	(17.225)	(9.682)	(30.319)	(144)	(293)
0	0	(390.149)	(518.212)	0	0	(339)	(583)
0	(2.379)	(189.373)	(194.452)	(1.295)	(37.060)	0	(583)
0	0	(1.138.427)	(1.654.287)	(185.803)	0	(3.439)	(1.310)
(81)	(834)	(79)	(596)	(1.980)	(1.097)	0	0
(86)	(109)	(407)	(547)	(1.018)	(656)	(6)	(6)
0	0	(345.192)	(316.493)	0	0	0	0
0	0	0	0	0	0	0	0
0	0	(9)	(8)	(9)	(5)	0	0
0	0	0	0	0	0	0	0
0	0	(24)	(21)	0	0	0	0
0	0	(8.285)	(18.210)	(24.067)	(15.583)	(298)	(231)
(1.753)	(952)	(15.232)	(35.034)	(34.423)	(5.491)	(380)	0
0	0	0	0	0	0	0	0
(2.277)	(4.511)	(2.099.468)	(2.755.085)	(258.277)	(90.211)	(4.606)	(3.006)
$ 97.091	$ 120.137	$ 620.336	$ 849.148	$ 1.803.959	$ 1.008.739	$ 11.547	$ 9.528

Aufstellung der Aktiva und Passiva (Forts.)

(Angaben in Tausend)	Strategic Income Fund Zum 30. Jun. 2023	Strategic Income Fund Zum 31. Dez. 2022	Total Return Bond Fund Zum 30. Jun. 2023	Total Return Bond Fund Zum 31. Dez. 2022
Aktiva:				
Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertetes Finanzvermögen:				
Übertragbare Wertpapiere	$ 597.009	$ 610.560	$ 5.534.034	$ 4.770.861
Investmentfonds	23.276	29.661	260.029	292.421
Pensionsgeschäfte	2.001	781	1.321	170.895
Einlagen bei Kreditinstituten	0	0	0	0
Finanzderivate	50.874	53.205	58.332	110.789
Zahlungsmittel	622	4.623	14.565	15.733
Einlagen bei Kontrahenten	11.635	11.922	95.186	120.293
Forderungen aus Einkünften	2.935	2.787	30.502	25.541
Forderungen aus verkauften Anlagen	6.251	4.738	3.813	51.883
Forderungen aus verkauften TBA-Anlagen	313.035	224.967	1.761.849	2.180.028
Forderungen aus verkauften Fondsanteilen	250	385	2.493	12.045
Forderungen aus Derivate-Gewinnen	14.397	14.864	49.719	77.114
Sonstige Aktiva	0	0	0	0
Summe Aktiva	1.022.285	958.493	7.811.843	7.827.603
Passiva:				
Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete Finanzverbindlichkeiten:				
Finanzderivate	(38.322)	(36.766)	(83.466)	(106.644)
Zeitwert der leerverkauften Wertpapiere	(8.958)	(13.092)	(68.600)	(68.457)
Verbindlichkeiten aus erworbenen Anlagen	(32)	(741)	(2.498)	(6.344)
Verbindlichkeiten aus erworbenen TBA-Anlagen	(484.953)	(367.853)	(3.274.412)	(3.304.650)
Verbindlichkeiten aus Fondsrücknahmen	(679)	(539)	(2.603)	(3.734)
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühr	(505)	(585)	(2.665)	(2.652)
Verbindlichkeiten aus Pensionsgeschäften	0	0	(9.407)	(1.745)
Zahlbar für Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte	0	0	(7.982)	(76.810)
Verbindlichkeiten aus Aufwendungen	(14)	(17)	(215)	(210)
Überziehungskredit	0	0	0	0
Zu zahlende Dividende	0	0	(167)	(186)
Verbindlichkeiten aus Derivatemargen	(21.250)	(21.409)	(23.821)	(72.167)
Einlagen von Kontrahenten	(5.636)	(10.934)	(9.638)	(33.287)
Sonstige Verbindlichkeiten	0	0	0	0
Summe Passiva ohne Nettovermögen der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber	(560.349)	(451.936)	(3.485.474)	(3.676.886)
Nettovermögen der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber	$ 461.936	$ 506.557	$ 4.326.369	$ 4.150.717

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

PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund		UK Corporate Bond Fund		UK Long Term Corporate Bond Fund		US High Yield Bond Fund	
Zum 30. Jun. 2023	Zum 31. Dez. 2022	Zum 30. Jun. 2023	Zum 31. Dez. 2022	Zum 30. Jun. 2023	Zum 31. Dez. 2022	Zum 30. Jun. 2023	Zum 31. Dez. 2022
$ 237.254	$ 335.879	£ 345.995	£ 372.745	£ 289.477	£ 309.110	$ 1.868.312	$ 1.895.465
30.015	41.693	208	5.370	0	0	67.844	39.162
4.583	27.452	13.102	177	1.922	269	10.034	9.269
0	600	0	0	0	0	0	0
68.482	42.556	3.019	4.161	4.623	8.017	10.846	12.684
2.862	3.994	530	1.084	572	0	576	550
29.400	28.858	3.217	7.199	4.147	14.086	17.435	10.449
2.063	1.601	4.552	4.405	5.276	4.594	29.928	31.884
0	134	2	1.522	0	0	35	3.204
78.701	25.221	1.866	0	0	0	0	0
18	11.015	91	61	0	0	2.730	1.390
26.120	17.270	6.430	7.000	2.394	15.391	2.247	270
0	0	0	0	0	0	22	186
479.498	536.273	379.012	403.724	308.411	351.467	2.010.009	2.004.513
(55.552)	(44.109)	(3.004)	(1.718)	(1.799)	(3.697)	(2.128)	(1.517)
(31.575)	0	0	0	0	0	0	0
(73)	(523)	(1.698)	0	0	0	(5.603)	(4.262)
(49.182)	(30.301)	(6.493)	0	0	0	0	0
(239)	(3.552)	(178)	(70)	(3)	0	(6.335)	(2.743)
(310)	(453)	(104)	(127)	(113)	(131)	(1.114)	(1.173)
0	0	(25.054)	0	(2.915)	0	(9.486)	0
0	0	0	0	0	0	0	0
(1)	0	0	0	0	0	(76)	(148)
0	0	0	0	0	(2.154)	0	0
(539)	(317)	(1.895)	(1.865)	(415)	(371)	(40)	(20)
(21.978)	(16.064)	(5.751)	(10.440)	(5.213)	(19.583)	(2.839)	(1.779)
(17.685)	(5.030)	0	(331)	(41)	(511)	(4.787)	(7.949)
0	0	0	0	0	0	0	0
(177.134)	(100.349)	(44.177)	(14.551)	(10.499)	(26.447)	(32.408)	(19.591)
$ 302.364	$ 435.924	£ 334.835	£ 389.173	£ 297.912	£ 325.020	$ 1.977.601	$ 1.984.922

Aufstellung der Aktiva und Passiva (Forts.)

(Angaben in Tausend)	US Investment Grade Corporate Bond Fund Zum 30. Jun. 2023	US Investment Grade Corporate Bond Fund Zum 31. Dez. 2022	US Short-Term Fund Zum 30. Jun. 2023	US Short-Term Fund Zum 31. Dez. 2022
Aktiva:				
Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertetes Finanzvermögen:				
Übertragbare Wertpapiere	$ 384.707	$ 346.399	$ 2.175.664	$ 1.891.711
Investmentfonds	43.534	38.657	206.887	226.018
Pensionsgeschäfte	25.268	15.383	227.937	154.472
Einlagen bei Kreditinstituten	0	0	0	0
Finanzderivate	7.629	8.390	8.510	10.584
Zahlungsmittel	922	796	4.031	1.993
Einlagen bei Kontrahenten	11.854	12.615	13.803	18.130
Forderungen aus Einkünften	4.197	3.400	11.805	12.016
Forderungen aus verkauften Anlagen	782	27.549	670	4.313
Forderungen aus verkauften TBA-Anlagen	18.074	21.983	0	0
Forderungen aus verkauften Fondsanteilen	278	2.561	2.294	6.106
Forderungen aus Derivate-Gewinnen	2.177	5.621	4.922	5.389
Sonstige Aktiva	0	0	0	0
Summe Aktiva	499.422	483.354	2.656.523	2.330.732
Passiva:				
Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete Finanzverbindlichkeiten:				
Finanzderivate	(2.679)	(7.500)	(7.229)	(5.824)
Zeitwert der leerverkauften Wertpapiere	0	(2.035)	0	0
Verbindlichkeiten aus erworbenen Anlagen	(1.448)	0	(571.126)	(1.430)
Verbindlichkeiten aus erworbenen TBA-Anlagen	(43.153)	(39.829)	0	0
Verbindlichkeiten aus Fondsrücknahmen	(949)	(58)	(3.299)	(2.669)
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühr	(209)	(182)	(643)	(722)
Verbindlichkeiten aus Pensionsgeschäften	0	0	0	0
Zahlbar für Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte	0	(38.655)	0	0
Verbindlichkeiten aus Aufwendungen	0	0	(4)	(4)
Überziehungskredit	0	0	0	0
Zu zahlende Dividende	(303)	(156)	0	0
Verbindlichkeiten aus Derivatemargen	(3.703)	(4.541)	(3.099)	(4.603)
Einlagen von Kontrahenten	(2.185)	(1.876)	(4.219)	(5.365)
Sonstige Verbindlichkeiten	0	0	0	0
Summe Passiva ohne Nettovermögen der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber	(54.629)	(94.832)	(589.619)	(20.617)
Nettovermögen der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber	$ 444.793	$ 388.522	$ 2.066.904	$ 2.310.115

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

* Die Summe der Gesellschaft zum 30. Juni 2023 und zum 31. Dezember 2022 wurde bereinigt, um Überkreuzinvestitionen und Salden im Namen der Gesellschaft Rechnung zu tragen. Nähere Einzelheiten zu Überkreuzinvestitionen sind Erläuterung 10 in den Erläuterungen zum Abschluss zu entnehmen.

Summe der Gesellschaft*	
Zum 30. Jun. 2023	Zum 31. Dez. 2022
$ 175.726.198	$ 158.067.452
7.615.215	7.205.963
7.770.096	10.455.165
64.638	11.759
7.870.090	8.087.908
298.962	369.095
4.105.461	4.738.366
1.205.157	1.097.303
673.066	1.035.370
44.050.900	36.037.151
407.359	405.829
2.872.421	3.520.113
145	662
252.659.708	231.032.136
(6.099.929)	(7.088.064)
(1.735.668)	(2.699.152)
(1.710.524)	(3.353.495)
(76.766.692)	(57.317.614)
(162.124)	(417.932)
(108.908)	(108.234)
(2.905.029)	(2.874.391)
(90.782)	(303.953)
(7.910)	(7.630)
0	(20.563)
(47.128)	(30.796)
(3.314.886)	(4.103.580)
(1.405.852)	(1.182.210)
(2)	(3)
(94.355.434)	(79.507.617)
$ 158.304.274	$ 151.524.519

Betriebsergebnisrechnung

(Angaben in Tausend)	PIMCO Asia High Yield Bond Fund		Asia Strategic Interest Bond Fund	
	Am 30. Jun. 2023 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2023 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum
Erträge				
Zins- und Dividendenerträge	$ 127.322	$ 102.800	$ 10.414	$ 7.131
Sonstige Erträge	0	0	65	0
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus übertragbaren Wertpapieren, Investmentfonds, Pensionsgeschäften und Einlagen bei Kreditinstituten	(127.920)	(172.495)	(11.781)	(13.972)
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus derivativen Finanzinstrumenten	16.031	(35.312)	2.220	(5.775)
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Fremdwährung	22	(103)	21	(144)
Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus übertragbaren Wertpapieren, Investmentfonds, Pensionsgeschäften und Einlagen bei Kreditinstituten	(6.170)	(629.811)	5.133	(40.925)
Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus derivativen Finanzinstrumenten	(10.526)	(32.123)	(765)	(4.392)
Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus Fremdwährung	(54)	(118)	(10)	(7)
Gesamtanlageertrag/(-verlust)	(1.295)	(767.162)	5.297	(58.084)
Betriebskosten				
Verwaltungsgebühr	(9.601)	(10.534)	(1.035)	(1.032)
Servicegebühr	(145)	(376)	0	0
Bestandspflegegebühr	(68)	(98)	0	0
Sonstige Aufwendungen	(2)	(2)	0	0
Gesamtaufwendungen	(9.816)	(11.010)	(1.035)	(1.032)
Erstattungen der Anlageberatungsgesellschaft	8	8	2	2
Betriebskosten, netto	(9.808)	(11.002)	(1.033)	(1.030)
Anlageerträge/(-verluste), netto	(11.103)	(778.164)	4.264	(59.114)
Finanzierungskosten				
Zinsaufwendungen	(61)	(235)	(30)	0
Aufwand für Kreditfazilitäten	0	0	0	0
Ausschüttungen an rückgabe- und gewinnberechtigte Anteilinhaber	(17.012)	(23.232)	(5.596)	(3.822)
Nettoausgleichskredite und -gebühren	(545)	77	2	31
Summe Finanzierungskosten	(17.618)	(23.390)	(5.624)	(3.791)
Gewinne/(Verluste) im Berichtszeitraum vor Steuern	(28.721)	(801.554)	(1.360)	(62.905)
Quellensteuern auf Dividenden und sonstige Anlageerträge	0	0	0	(3)
Kapitalertragsteuer	0	0	0	0
Gewinne/(Verluste) im Berichtszeitraum nach Steuern	(28.721)	(801.554)	(1.360)	(62.908)
Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens der rücknahme- und gewinnberechtigten Anteilinhaber aus der Geschäftstätigkeit	$ (28.721)	$ (801.554)	$ (1.360)	$ (62.908)

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

PIMCO Capital Securities Fund		PIMCO Climate Bond Fund		Commodity Real Return Fund		PIMCO Credit Opportunities Bond Fund	
Am 30. Jun. 2023 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2023 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2023 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2023 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum
$ 170.864	$ 160.238	$ 5.112	$ 3.144	$ 20.182	$ 61.718	$ 2.759	$ 2.145
14	0	0	0	68	0	65	0
(550.340)	(59.121)	(10.449)	(3.827)	(45.548)	(23.145)	(173)	(1.716)
(4.548)	164.830	(2.927)	1.355	(118.831)	561.745	6	(2.772)
(7.044)	(57.669)	(394)	74	25	(7.225)	(28)	(46)
393.969	(1.651.927)	17.685	(60.258)	60.903	(162.956)	1.051	(11.044)
(35.289)	24.401	1.801	(9.486)	(14.337)	(266.379)	478	(1.710)
692	1.836	(19)	7	(685)	(327)	7	(2)
(31.682)	(1.417.412)	10.809	(68.991)	(98.223)	163.431	4.165	(15.145)
(27.395)	(35.732)	(887)	(878)	(6.190)	(10.564)	(528)	(686)
(551)	(965)	0	(5)	(67)	(146)	0	0
(603)	(669)	0	0	0	0	0	0
(167)	(191)	(8)	(8)	(1)	(1)	0	0
(28.716)	(37.557)	(895)	(891)	(6.258)	(10.711)	(528)	(686)
0	302	0	0	0	0	1	1
(28.716)	(37.255)	(895)	(891)	(6.258)	(10.711)	(527)	(685)
(60.398)	(1.454.667)	9.914	(69.882)	(104.481)	152.720	3.638	(15.830)
(9.931)	(1.484)	(4)	0	(9.408)	(151)	(6)	(149)
0	0	0	0	0	0	0	0
(39.969)	(42.121)	(1.972)	(1.074)	(566)	0	0	0
(1.417)	(2.130)	34	76	(34)	0	0	0
(51.317)	(45.735)	(1.942)	(998)	(10.008)	(151)	(6)	(149)
(111.715)	(1.500.402)	7.972	(70.880)	(114.489)	152.569	3.632	(15.979)
(26)	(315)	2	3	1	1	(1)	6
0	0	0	0	0	0	0	0
(111.741)	(1.500.717)	7.974	(70.877)	(114.488)	152.570	3.631	(15.973)
$ (111.741)	$ (1.500.717)	$ 7.974	$ (70.877)	$ (114.488)	$ 152.570	$ 3.631	$ (15.973)

Aufwands- und Ertragsrechnung (Forts.)

(Angaben in Tausend)	Diversified Income Fund		Diversified Income Duration Hedged Fund	
	Am 30. Jun. 2023 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2023 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum
Erträge				
Zins- und Dividendenerträge	$ 209.219	$ 231.966	$ 13.553	$ 18.087
Sonstige Erträge	1.911	0	197	0
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus übertragbaren Wertpapieren, Investmentfonds, Pensionsgeschäften und Einlagen bei Kreditinstituten	(184.578)	(248.907)	(12.205)	(17.443)
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus derivativen Finanzinstrumenten	65.169	(538.653)	12.129	(9.888)
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Fremdwährung	(10.292)	(71.471)	203	(2.883)
Nettoveränderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus Wertpapieren, Investmentfonds, Pensionsgeschäften und Einlagen bei Kreditinstituten	276.276	(2.134.224)	16.730	(160.520)
Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus derivativen Finanzinstrumenten	25.065	(487.131)	8.649	(33.646)
Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus Fremdwährung	171	(4.272)	29	(278)
Gesamtanlageertrag/(-verlust)	382.941	(3.252.692)	39.285	(206.571)
Betriebskosten				
Verwaltungsgebühr	(45.117)	(67.929)	(2.456)	(4.479)
Servicegebühr	(312)	(291)	(9)	(17)
Bestandspflegegebühr	(365)	(540)	0	0
Sonstige Aufwendungen	(217)	(241)	0	(1)
Gesamtaufwendungen	(46.011)	(69.001)	(2.465)	(4.497)
Erstattungen der Anlageberatungsgesellschaft	464	1.070	1	76
Betriebskosten, netto	(45.547)	(67.931)	(2.464)	(4.421)
Anlageerträge/(-verluste), netto	337.394	(3.320.623)	36.821	(210.992)
Finanzierungskosten				
Zinsaufwendungen	(1.699)	(65)	(119)	(9)
Aufwand für Kreditfazilitäten	0	0	0	0
Ausschüttungen an rückgabe- und gewinnberechtigte Anteilinhaber	(63.554)	(82.528)	(4.882)	(6.214)
Nettoausgleichskredite und -gebühren	(2.594)	(4.287)	94	(228)
Summe Finanzierungskosten	(67.847)	(86.880)	(4.907)	(6.451)
Gewinne/(Verluste) im Berichtszeitraum vor Steuern	269.547	(3.407.503)	31.914	(217.443)
Quellensteuern auf Dividenden und sonstige Anlageerträge	(16)	209	0	16
Kapitalertragsteuer	0	0	0	0
Gewinne/(Verluste) im Berichtszeitraum nach Steuern	269.531	(3.407.294)	31.914	(217.427)
Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens der rücknahme- und gewinnberechtigten Anteilinhaber aus der Geschäftstätigkeit	$ 269.531	$ (3.407.294)	$ 31.914	$ (217.427)

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

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

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

Diversified Income ESG Fund[1]	Dynamic Bond Fund		Dynamic Multi-Asset Fund		Emerging Local Bond Fund		Emerging Local Bond ESG Fund[2]
Am 30. Jun. 2023 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2023 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2023 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2023 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2023 abgeschlossener Berichtszeitraum
$ 701	$ 83.905	$ 39.672	€ 60.266	€ 26.755	$ 84.704	$ 56.141	$ 243
0	2.045	0	0	0	498	0	0
(2)	(3.875)	3.920	(123.631)	52.910	(8.824)	(103.116)	97
(265)	50.224	(106.614)	(171.519)	87.867	41.594	38.937	47
(307)	(22.506)	(4.667)	7.680	19.831	3.626	(8.902)	10
(201)	14.326	(286.244)	162.189	(753.300)	97.627	(227.906)	327
(205)	106.698	(60.781)	12.190	(125.561)	7.059	(23.421)	(47)
0	586	(655)	22.296	897	(4.724)	(1.854)	0
(279)	231.403	(415.369)	(30.529)	(690.601)	221.560	(270.121)	677
(98)	(16.606)	(13.868)	(30.207)	(42.520)	(11.305)	(9.592)	(26)
0	(84)	(105)	(19)	(19)	(36)	(59)	0
0	(64)	(97)	0	0	0	0	0
(1)	(3)	(1)	(175)	(209)	(1)	(1)	0
(99)	(16.757)	(14.071)	(30.401)	(42.748)	(11.342)	(9.652)	(26)
0	228	231	565	621	0	0	0
(99)	(16.529)	(13.840)	(29.836)	(42.127)	(11.342)	(9.652)	(26)
(378)	214.874	(429.209)	(60.365)	(732.728)	210.218	(279.773)	651
0	(797)	(28)	(636)	(647)	(5.964)	(3.419)	(3)
0	0	0	0	0	0	0	0
0	(4.869)	(3.803)	(3.405)	(3.860)	(8.029)	(5.728)	(2)
0	(47)	(684)	479	(107)	261	(8)	0
0	(5.713)	(4.515)	(3.562)	(4.614)	(13.732)	(9.155)	(5)
(378)	209.161	(433.724)	(63.927)	(737.342)	196.486	(288.928)	646
(2)	(49)	11	(2.177)	(6.884)	(739)	(523)	(2)
0	0	(11)	0	0	(673)	(154)	(9)
(380)	209.112	(433.724)	(66.104)	(744.226)	195.074	(289.605)	635
$ (380)	$ 209.112	$ (433.724)	€ (66.104)	€ (744.226)	$ 195.074	$ (289.605)	$ 635

Aufwands- und Ertragsrechnung (Forts.)

(Angaben in Tausend)	Emerging Markets Bond Fund		Emerging Markets Bond ESG Fund	
	Am 30. Jun. 2023 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2023 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum
Erträge				
Zins- und Dividendenerträge	$ 108.490	$ 102.966	$ 69.582	$ 60.303
Sonstige Erträge	1.298	0	0	0
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus übertragbaren Wertpapieren, Investmentfonds, Pensionsgeschäften und Einlagen bei Kreditinstituten	(34.567)	(136.347)	(75.552)	(74.275)
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus derivativen Finanzinstrumenten	9.227	(113.944)	20.332	(105.036)
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Fremdwährung	2.144	(3.818)	944	(1.992)
Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus übertragbaren Wertpapieren, Investmentfonds, Pensionsgeschäften und Einlagen bei Kreditinstituten	81.031	(749.330)	107.494	(540.974)
Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus derivativen Finanzinstrumenten	2.443	(70.546)	(2.752)	(49.893)
Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus Fremdwährung	858	(69)	122	(222)
Gesamtanlageertrag/(-verlust)	170.924	(971.088)	120.170	(712.089)
Betriebskosten				
Verwaltungsgebühr	(14.672)	(17.626)	(10.963)	(10.984)
Servicegebühr	(13)	(17)	(5)	(3)
Bestandspflegegebühr	(56)	(79)	(3)	(4)
Sonstige Aufwendungen	(3)	(2)	(2)	(1)
Gesamtaufwendungen	(14.744)	(17.724)	(10.973)	(10.992)
Erstattungen der Anlageberatungsgesellschaft	0	0	0	0
Betriebskosten, netto	(14.744)	(17.724)	(10.973)	(10.992)
Anlageerträge/(-verluste), netto	156.180	(988.812)	109.197	(723.081)
Finanzierungskosten				
Zinsaufwendungen	(2.991)	(482)	(1.483)	(114)
Aufwand für Kreditfazilitäten	0	0	0	0
Ausschüttungen an rückgabe- und gewinnberechtigte Anteilinhaber	(19.646)	(27.780)	(13.396)	(13.814)
Nettoausgleichskredite und -gebühren	156	254	(838)	547
Summe Finanzierungskosten	(22.481)	(28.008)	(15.717)	(13.381)
Gewinne/(Verluste) im Berichtszeitraum vor Steuern	133.699	(1.016.820)	93.480	(736.462)
Quellensteuern auf Dividenden und sonstige Anlageerträge	(119)	(59)	5	13
Kapitalertragsteuer	(5)	0	0	0
Gewinne/(Verluste) im Berichtszeitraum nach Steuern	133.575	(1.016.879)	93.485	(736.449)
Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens der rücknahme- und gewinnberechtigten Anteilinhaber aus der Geschäftstätigkeit	$ 133.575	$ (1.016.879)	$ 93.485	$ (736.449)

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

Emerging Markets Corporate Bond Fund		PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund		Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund		PIMCO ESG Income Fund	
Am 30. Jun. 2023 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2023 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2023 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2023 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum
$ 4.269	$ 3.937	$ 5.081	$ 4.790	$ 558	$ 321	$ 5.673	$ 1.828
274	0	0	0	144	0	0	0
(8.005)	(5.129)	(3.419)	(16.594)	168	(262)	(2.034)	(483)
2.942	(7.168)	4.580	1.705	670	(364)	(3.062)	559
1	(102)	(1.229)	502	122	(4)	251	(115)
7.136	(33.691)	4.216	(24.936)	103	(2.196)	3.258	(18.395)
(1.517)	(4.540)	2.929	(8.358)	(607)	497	(984)	(4.995)
6	(9)	17	(8)	14	(3)	81	43
5.106	(46.702)	12.175	(42.899)	1.172	(2.011)	3.183	(21.558)
(996)	(1.131)	(388)	(1.119)	(152)	(201)	(806)	(442)
0	0	0	0	0	0	0	0
0	0	0	0	0	0	(21)	0
0	0	0	0	0	0	(6)	0
(996)	(1.131)	(388)	(1.119)	(152)	(201)	(833)	(442)
0	0	1	1	3	4	0	0
(996)	(1.131)	(387)	(1.118)	(149)	(197)	(833)	(442)
4.110	(47.833)	11.788	(44.017)	1.023	(2.208)	2.350	(22.000)
(29)	(2)	(14)	(9)	(7)	(1)	0	0
0	0	0	0	0	0	0	0
0	0	(23)	(7)	0	0	(1.248)	(365)
0	0	0	0	0	0	4	(2)
(29)	(2)	(37)	(16)	(7)	(1)	(1.244)	(367)
4.081	(47.835)	11.751	(44.033)	1.016	(2.209)	1.106	(22.367)
(5)	2	(40)	(44)	(1)	(6)	0	(8)
0	0	8	5	1	(1)	0	0
4.076	(47.833)	11.719	(44.072)	1.016	(2.216)	1.106	(22.375)
$ 4.076	$ (47.833)	$ 11.719	$ (44.072)	$ 1.016	$ (2.216)	$ 1.106	$ (22.375)

Aufwands- und Ertragsrechnung (Forts.)

(Angaben in Tausend)	Euro Bond Fund		Euro Credit Fund	
	Am 30. Jun. 2023 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2023 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum
Erträge				
Zins- und Dividendenerträge	€ 22.648	€ 15.324	€ 7.837	€ 6.146
Sonstige Erträge	359	0	17	0
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus übertragbaren Wertpapieren, Investmentfonds, Pensionsgeschäften und Einlagen bei Kreditinstituten	(82.934)	(51.316)	(24.398)	(10.937)
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus derivativen Finanzinstrumenten	(31.337)	(69.476)	(961)	(45.245)
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Fremdwährung	4.011	1.769	371	2.065
Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus übertragbaren Wertpapieren, Investmentfonds, Pensionsgeschäften und Einlagen bei Kreditinstituten	67.301	(174.838)	28.907	(76.085)
Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus derivativen Finanzinstrumenten	68.666	142	8.150	(16.858)
Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus Fremdwährung	(603)	(929)	(594)	(104)
Gesamtanlageertrag/(-verlust)	48.111	(279.324)	19.329	(141.018)
Betriebskosten				
Verwaltungsgebühr	(4.987)	(5.840)	(1.453)	(2.174)
Servicegebühr	(30)	(34)	0	0
Bestandspflegegebühr	0	(6)	0	0
Sonstige Aufwendungen	(1)	(1)	0	(1)
Gesamtaufwendungen	(5.018)	(5.881)	(1.453)	(2.175)
Erstattungen der Anlageberatungsgesellschaft	329	275	89	92
Betriebskosten, netto	(4.689)	(5.606)	(1.364)	(2.083)
Anlageerträge/(-verluste), netto	43.422	(284.930)	17.965	(143.101)
Finanzierungskosten				
Zinsaufwendungen	(131)	(129)	(59)	(74)
Aufwand für Kreditfazilitäten	0	0	0	0
Ausschüttungen an rückgabe- und gewinnberechtigte Anteilinhaber	(537)	(473)	(202)	(781)
Nettoausgleichskredite und -gebühren	(35)	(4)	(9)	11
Summe Finanzierungskosten	(703)	(606)	(270)	(844)
Gewinne/(Verluste) im Berichtszeitraum vor Steuern	42.719	(285.536)	17.695	(143.945)
Quellensteuern auf Dividenden und sonstige Anlageerträge	(51)	2	0	1
Kapitalertragsteuer	0	0	0	0
Gewinne/(Verluste) im Berichtszeitraum nach Steuern	42.668	(285.534)	17.695	(143.944)
Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens der rücknahme- und gewinnberechtigten Anteilinhaber aus der Geschäftstätigkeit	€ 42.668	€ (285.534)	€ 17.695	€ (143.944)

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

Euro Income Bond Fund		Euro Long Average Duration Fund		Euro Short-Term Fund		PIMCO European High Yield Bond Fund	
Am 30. Jun. 2023 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2023 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2023 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2023 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum
€ 20.803	€ 22.950	€ 1.471	€ 871	€ 3.681	€ 1.448	€ 5.210	€ 2.919
6	0	63	0	12	0	0	0
(48.614)	(35.223)	(20.288)	(3.560)	(3.351)	(1.234)	(6.228)	(1.032)
9.453	(14.618)	(13.811)	(12.896)	1.343	4.763	678	(1.939)
5.817	7.059	243	32	(170)	996	117	179
49.623	(207.195)	21.727	(24.392)	4.196	(17.953)	8.574	(23.505)
4.948	(40.275)	15.292	(1.445)	(977)	2.434	60	(513)
251	175	(57)	(36)	134	62	(35)	(23)
42.287	(267.127)	4.640	(41.426)	4.868	(9.484)	8.376	(23.914)
(7.214)	(10.341)	(259)	(312)	(448)	(851)	(219)	(25)
(33)	(39)	0	0	0	0	0	0
0	0	0	0	0	0	0	0
(68)	(80)	0	0	0	0	0	0
(7.315)	(10.460)	(259)	(312)	(448)	(851)	(219)	(25)
195	142	12	4	0	0	19	15
(7.120)	(10.318)	(247)	(308)	(448)	(851)	(200)	(10)
35.167	(277.445)	4.393	(41.734)	4.420	(10.335)	8.176	(23.924)
(243)	(120)	(13)	(8)	(8)	(52)	(3)	(26)
0	0	0	0	0	0	0	0
(6.848)	(7.858)	0	0	0	0	0	0
(31)	(544)	0	0	0	0	0	0
(7.122)	(8.522)	(13)	(8)	(8)	(52)	(3)	(26)
28.045	(285.967)	4.380	(41.742)	4.412	(10.387)	8.173	(23.950)
(1)	2	(7)	0	2	0	0	0
0	0	0	0	0	0	0	0
28.044	(285.965)	4.373	(41.742)	4.414	(10.387)	8.173	(23.950)
€ 28.044	€ (285.965)	€ 4.373	€ (41.742)	€ 4.414	€ (10.387)	€ 8.173	€ (23.950)

Aufwands- und Ertragsrechnung (Forts.)

(Angaben in Tausend)	PIMCO European Short-Term Opportunities Fund		Global Advantage Fund	
	Am 30. Jun. 2023 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2023 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum
Erträge				
Zins- und Dividendenerträge	€ 2.654	€ 2.451	$ 7.573	$ 8.331
Sonstige Erträge	2	0	166	0
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus übertragbaren Wertpapieren, Investmentfonds, Pensionsgeschäften und Einlagen bei Kreditinstituten	(8.500)	(6.872)	(8.671)	(4.236)
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus derivativen Finanzinstrumenten	1.303	9.870	3.498	(8.952)
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Fremdwährung	155	565	316	(477)
Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus übertragbaren Wertpapieren, Investmentfonds, Pensionsgeschäften und Einlagen bei Kreditinstituten	9.649	(25.579)	14.032	(64.938)
Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus derivativen Finanzinstrumenten	(3.786)	9.133	(6.890)	(7.107)
Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus Fremdwährung	14	(182)	(299)	1.595
Gesamtanlageertrag/(-verlust)	1.491	(10.614)	9.725	(75.784)
Betriebskosten				
Verwaltungsgebühr	(355)	(645)	(1.465)	(1.725)
Servicegebühr	0	0	0	0
Bestandspflegegebühr	0	0	0	0
Sonstige Aufwendungen	0	0	0	0
Gesamtaufwendungen	(355)	(645)	(1.465)	(1.725)
Erstattungen der Anlageberatungsgesellschaft	25	49	0	0
Betriebskosten, netto	(330)	(596)	(1.465)	(1.725)
Anlageerträge/(-verluste), netto	1.161	(11.210)	8.260	(77.509)
Finanzierungskosten				
Zinsaufwendungen	(17)	(30)	(81)	(51)
Aufwand für Kreditfazilitäten	0	0	0	0
Ausschüttungen an rückgabe- und gewinnberechtigte Anteilinhaber	0	0	(2.225)	(1.978)
Nettoausgleichskredite und -gebühren	0	0	0	0
Summe Finanzierungskosten	(17)	(30)	(2.306)	(2.029)
Gewinne/(Verluste) im Berichtszeitraum vor Steuern	1.144	(11.240)	5.954	(79.538)
Quellensteuern auf Dividenden und sonstige Anlageerträge	(5)	0	(6)	(13)
Kapitalertragsteuer	0	0	(8)	9
Gewinne/(Verluste) im Berichtszeitraum nach Steuern	1.139	(11.240)	5.940	(79.542)
Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens der rücknahme- und gewinnberechtigten Anteilinhaber aus der Geschäftstätigkeit	€ 1.139	€ (11.240)	$ 5.940	$ (79.542)

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

Global Bond Fund		Global Bond ESG Fund		Global Bond Ex-US Fund		PIMCO Global Core Asset Allocation Fund	
Am 30. Jun. 2023 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2023 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2023 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2023 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum
$ 172.649	$ 135.508	$ 50.235	$ 17.566	$ 10.248	$ 9.449	$ 12.416	$ 6.371
3.707	0	0	0	285	0	729	0
(144.975)	(138.224)	(6.283)	(64.696)	(4.851)	(5.494)	(2.455)	(16.957)
(60.657)	70.835	(74.830)	(12.939)	(9.960)	11.576	20.337	(117.852)
(21.493)	(45.306)	(201)	(9.773)	(1.230)	(4.054)	(2.083)	(127)
1.883	(1.646.386)	(49.756)	(277.444)	(6.532)	(110.407)	(15.061)	(59.134)
428.444	(259.223)	148.590	(64.724)	39.158	14.705	39.440	(35.070)
(7.263)	17.446	(1.859)	(501)	(839)	2.461	(409)	(281)
372.295	(1.865.350)	65.896	(412.511)	26.279	(81.764)	52.914	(223.050)
(36.839)	(39.175)	(8.138)	(5.582)	(1.949)	(2.261)	(4.774)	(5.477)
(766)	(718)	(17)	(19)	(12)	(16)	(18)	(16)
(58)	(56)	0	(2)	(26)	(30)	0	0
(63)	(71)	(2)	(1)	0	0	0	0
(37.726)	(40.020)	(8.157)	(5.604)	(1.987)	(2.307)	(4.792)	(5.493)
1.396	1.564	0	0	1	1	166	176
(36.330)	(38.456)	(8.157)	(5.604)	(1.986)	(2.306)	(4.626)	(5.317)
335.965	(1.903.806)	57.739	(418.115)	24.293	(84.070)	48.288	(228.367)
(2.651)	(640)	(746)	(55)	(173)	(79)	(260)	(41)
0	0	0	0	0	0	0	0
(16.775)	(14.147)	(7.316)	(3.468)	(1.208)	(901)	(1.398)	(1.527)
714	(326)	(378)	117	44	(68)	(29)	(363)
(18.712)	(15.113)	(8.440)	(3.406)	(1.337)	(1.048)	(1.687)	(1.931)
317.253	(1.918.919)	49.299	(421.521)	22.956	(85.118)	46.601	(230.298)
4	(225)	(658)	(37)	(3)	(12)	(295)	(373)
0	(3)	0	0	0	0	0	0
317.257	(1.919.147)	48.641	(421.558)	22.953	(85.130)	46.306	(230.671)
$ 317.257	$ (1.919.147)	$ 48.641	$ (421.558)	$ 22.953	$ (85.130)	$ 46.306	$ (230.671)

Aufwands- und Ertragsrechnung (Forts.)

(Angaben in Tausend)	Global High Yield Bond Fund		Global Investment Grade Credit Fund	
	Am 30. Jun. 2023 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2023 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum
Erträge				
Zins- und Dividendenerträge	$ 82.477	$ 102.882	$ 213.040	$ 206.572
Sonstige Erträge	996	0	3.970	0
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus übertragbaren Wertpapieren, Investmentfonds, Pensionsgeschäften und Einlagen bei Kreditinstituten	(64.412)	(8.163)	(320.703)	(364.265)
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus derivativen Finanzinstrumenten	32.096	(87.771)	31.909	(436.718)
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Fremdwährung	(3.581)	(13.879)	(10.330)	(38.102)
Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus übertragbaren Wertpapieren, Investmentfonds, Pensionsgeschäften und Einlagen bei Kreditinstituten	136.901	(831.242)	483.163	(2.030.117)
Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus derivativen Finanzinstrumenten	351	(71.956)	69.898	(223.463)
Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus Fremdwährung	(613)	(274)	(1.441)	(6.696)
Gesamtanlageertrag/(-verlust)	184.215	(910.403)	469.506	(2.892.789)
Betriebskosten				
Verwaltungsgebühr	(11.191)	(15.462)	(35.438)	(42.302)
Servicegebühr	(17)	(32)	(1.200)	(1.376)
Bestandspflegegebühr	(121)	(187)	(591)	(785)
Sonstige Aufwendungen	(19)	(21)	(70)	(83)
Gesamtaufwendungen	(11.348)	(15.702)	(37.299)	(44.546)
Erstattungen der Anlageberatungsgesellschaft	0	0	445	449
Betriebskosten, netto	(11.348)	(15.702)	(36.854)	(44.097)
Anlageerträge/(-verluste), netto	172.867	(926.105)	432.652	(2.936.886)
Finanzierungskosten				
Zinsaufwendungen	(394)	(63)	(989)	(1.584)
Aufwand für Kreditfazilitäten	(350)	(313)	0	0
Ausschüttungen an rückgabe- und gewinnberechtigte Anteilinhaber	(26.056)	(33.177)	(49.362)	(55.106)
Nettoausgleichskredite und -gebühren	65	385	482	(3.834)
Summe Finanzierungskosten	(26.735)	(33.168)	(49.869)	(60.524)
Gewinne/(Verluste) im Berichtszeitraum vor Steuern	146.132	(959.273)	382.783	(2.997.410)
Quellensteuern auf Dividenden und sonstige Anlageerträge	0	0	(188)	(227)
Kapitalertragsteuer	0	0	0	0
Gewinne/(Verluste) im Berichtszeitraum nach Steuern	146.132	(959.273)	382.595	(2.997.637)
Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens der rücknahme- und gewinnberechtigten Anteilinhaber aus der Geschäftstätigkeit	$ 146.132	$ (959.273)	$ 382.595	$ (2.997.637)

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

Global Investment Grade Credit ESG Fund		Global Low Duration Real Return Fund		Global Real Return Fund		Income Fund	
Am 30. Jun. 2023 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2023 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2023 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2023 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum
$ 32.154	$ 17.311	$ 26.758	$ 43.394	$ 29.916	$ 130.217	$ 1.539.543	$ 1.081.564
0	0	0	0	1.734	0	0	0
(38.347)	(19.154)	(22.734)	(18.461)	(65.319)	(82.178)	(890.181)	(1.327.161)
(11.095)	(23.201)	19.436	19.213	15.092	154.697	866.814	388.804
(293)	(8.975)	72	(3.491)	(3.548)	(16.457)	(34.847)	(63.921)
55.391	(264.585)	35.544	(110.034)	129.216	(791.364)	977.376	(7.982.341)
1.426	(39.232)	(20.176)	(14.347)	(11.965)	2.983	(257.063)	(885.815)
(179)	(386)	338	201	736	95	36.810	9.998
39.057	(338.222)	39.238	(83.525)	95.862	(602.007)	2.238.452	(8.778.872)
(4.209)	(3.579)	(4.389)	(3.656)	(8.243)	(10.799)	(287.322)	(296.445)
0	0	(12)	(11)	(152)	(248)	(6.709)	(8.044)
(798)	(722)	0	0	(103)	(167)	(15.644)	(15.404)
(1)	(1)	(1)	(1)	(2)	(2)	(1.729)	(1.892)
(5.008)	(4.302)	(4.402)	(3.668)	(8.500)	(11.216)	(311.404)	(321.785)
0	0	0	0	0	0	499	504
(5.008)	(4.302)	(4.402)	(3.668)	(8.500)	(11.216)	(310.905)	(321.281)
34.049	(342.524)	34.836	(87.193)	87.362	(613.223)	1.927.547	(9.100.153)
(3.342)	(116)	(8.678)	(481)	(19.567)	(2.042)	(8.155)	(1.638)
0	0	0	0	0	0	0	0
(7.612)	(5.659)	(3.796)	(4.566)	(16.743)	(21.808)	(968.561)	(690.822)
(440)	826	(29)	(33)	46	(33)	(2.574)	(2.945)
(11.394)	(4.949)	(12.503)	(5.080)	(36.264)	(23.883)	(979.290)	(695.405)
22.655	(347.473)	22.333	(92.273)	51.098	(637.106)	948.257	(9.795.558)
(56)	(27)	(46)	0	(1)	8	(8.186)	(1.468)
0	0	0	0	0	(1)	(443)	(122)
22.599	(347.500)	22.287	(92.273)	51.097	(637.099)	939.628	(9.797.148)
$ 22.599	$ (347.500)	$ 22.287	$ (92.273)	$ 51.097	$ (637.099)	$ 939.628	$ (9.797.148)

Aufwands- und Ertragsrechnung (Forts.)

(Angaben in Tausend)	Income Fund II		Inflation Multi-Asset Fund	
	Am 30. Jun. 2023 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2023 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum
Erträge				
Zins- und Dividendenerträge	$ 2.160	$ 494	$ 4.991	$ 7.876
Sonstige Erträge	0	0	2	0
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus übertragbaren Wertpapieren, Investmentfonds, Pensionsgeschäften und Einlagen bei Kreditinstituten	(190)	(332)	(2.963)	1.543
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus derivativen Finanzinstrumenten	(405)	126	616	14.169
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Fremdwährung	122	(4)	1.000	(1.098)
Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus übertragbaren Wertpapieren, Investmentfonds, Pensionsgeschäften und Einlagen bei Kreditinstituten	886	(3.661)	7.057	(39.135)
Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus derivativen Finanzinstrumenten	(69)	(38)	(4.752)	(19.924)
Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus Fremdwährung	24	5	72	34
Gesamtanlageertrag/(-verlust)	2.528	(3.410)	6.023	(36.535)
Betriebskosten				
Verwaltungsgebühr	(531)	(130)	(2.281)	(2.015)
Servicegebühr	0	0	0	0
Bestandspflegegebühr	0	0	(21)	(14)
Sonstige Aufwendungen	(2)	(1)	0	0
Gesamtaufwendungen	(533)	(131)	(2.302)	(2.029)
Erstattungen der Anlageberatungsgesellschaft	0	0	0	0
Betriebskosten, netto	(533)	(131)	(2.302)	(2.029)
Anlageerträge/(-verluste), netto	1.995	(3.541)	3.721	(38.564)
Finanzierungskosten				
Zinsaufwendungen	(71)	0	(64)	(2)
Aufwand für Kreditfazilitäten	0	0	0	0
Ausschüttungen an rückgabe- und gewinnberechtigte Anteilinhaber	(1.680)	(187)	(323)	(359)
Nettoausgleichskredite und -gebühren	58	4	(4)	40
Summe Finanzierungskosten	(1.693)	(183)	(391)	(321)
Gewinne/(Verluste) im Berichtszeitraum vor Steuern	302	(3.724)	3.330	(38.885)
Quellensteuern auf Dividenden und sonstige Anlageerträge	(28)	0	(181)	(122)
Kapitalertragsteuer	0	0	0	0
Gewinne/(Verluste) im Berichtszeitraum nach Steuern	274	(3.724)	3.149	(39.007)
Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens der rücknahme- und gewinnberechtigten Anteilinhaber aus der Geschäftstätigkeit	$ 274	$ (3.724)	$ 3.149	$ (39.007)

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

Low Average Duration Fund		Low Duration Global Investment Grade Credit Fund		Low Duration Income Fund		Low Duration Opportunities Fund	
Am 30. Jun. 2023 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2023 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2023 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2023 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum
$ 21.660	$ 10.329	$ 14.194	$ 6.056	$ 31.699	$ 17.978	$ 23.132	$ 26.353
447	0	0	0	0	0	0	0
(18.982)	(22.364)	(5.391)	(9.517)	(17.630)	(32.369)	(20.610)	(8.053)
(7.707)	9.023	127	(31.826)	10.780	(29.879)	(1.233)	(155.897)
9	(1.331)	(334)	(2.046)	(423)	75	8.451	(5.750)
19.793	(62.880)	10.639	(47.040)	23.985	(105.544)	34.966	(256.550)
1.302	2.631	2.379	(19.231)	23.185	(31.490)	40.725	(149.249)
(417)	(70)	(66)	(94)	558	(143)	76	(277)
16.105	(64.662)	21.548	(103.698)	72.154	(181.372)	85.507	(549.423)
(2.723)	(4.068)	(1.994)	(1.907)	(4.028)	(4.242)	(2.886)	(8.069)
(32)	(47)	0	0	0	(1)	(8)	(12)
(25)	(30)	0	0	0	0	0	0
(1)	(1)	0	0	(1)	(1)	(1)	(2)
(2.781)	(4.146)	(1.994)	(1.907)	(4.029)	(4.244)	(2.895)	(8.083)
83	84	0	0	0	0	106	107
(2.698)	(4.062)	(1.994)	(1.907)	(4.029)	(4.244)	(2.789)	(7.976)
13.407	(68.724)	19.554	(105.605)	68.125	(185.616)	82.718	(557.399)
(3.162)	(53)	(532)	(46)	(275)	(12)	(269)	(43)
0	0	0	0	0	0	0	0
(879)	(384)	(248)	(202)	(2.284)	(2.762)	(4.241)	(4.267)
(99)	4	(2)	21	224	(295)	(255)	(56)
(4.140)	(433)	(782)	(227)	(2.335)	(3.069)	(4.765)	(4.366)
9.267	(69.157)	18.772	(105.832)	65.790	(188.685)	77.953	(561.765)
(20)	(35)	(40)	0	(3)	(4)	89	(12)
0	0	0	0	0	0	0	(2)
9.247	(69.192)	18.732	(105.832)	65.787	(188.689)	78.042	(561.779)
$ 9.247	$ (69.192)	$ 18.732	$ (105.832)	$ 65.787	$ (188.689)	$ 78.042	$ (561.779)

Aufwands- und Ertragsrechnung (Forts.)

(Angaben in Tausend)	Low Duration Opportunities ESG Fund[3]	PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund	
	Am 30. Jun. 2023 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2023 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum
Erträge			
Zins- und Dividendenerträge	$ 103	$ 2.443	$ 1.872
Sonstige Erträge	0	0	0
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus übertragbaren Wertpapieren, Investmentfonds, Pensionsgeschäften und Einlagen bei Kreditinstituten	20	1.586	8.257
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus derivativen Finanzinstrumenten	(47)	3.968	9.466
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Fremdwährung	(4)	22	(32)
Nettoveränderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus Wertpapieren, Investmentfonds, Pensionsgeschäften und Einlagen bei Kreditinstituten	(6)	(3.390)	(3.270)
Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus derivativen Finanzinstrumenten	37	771	(9.022)
Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus Fremdwährung	(1)	6	(3)
Gesamtanlageertrag/(-verlust)	102	5.406	7.268
Betriebskosten			
Verwaltungsgebühr	(13)	(565)	(677)
Servicegebühr	0	0	0
Bestandspflegegebühr	0	0	0
Sonstige Aufwendungen	0	0	0
Gesamtaufwendungen	(13)	(565)	(677)
Erstattungen der Anlageberatungsgesellschaft	0	0	0
Betriebskosten, netto	(13)	(565)	(677)
Anlageerträge/(-verluste), netto	89	4.841	6.591
Finanzierungskosten			
Zinsaufwendungen	0	(20)	(2)
Aufwand für Kreditfazilitäten	0	0	0
Ausschüttungen an rückgabe- und gewinnberechtigte Anteilinhaber	(1)	(658)	(1.019)
Nettoausgleichskredite und -gebühren	0	(35)	(162)
Summe Finanzierungskosten	(1)	(713)	(1.183)
Gewinne/(Verluste) im Berichtszeitraum vor Steuern	88	4.128	5.408
Quellensteuern auf Dividenden und sonstige Anlageerträge	0	(333)	(501)
Kapitalertragsteuer	0	0	0
Gewinne/(Verluste) im Berichtszeitraum nach Steuern	88	3.795	4.907
Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens der rücknahme- und gewinnberechtigten Anteilinhaber aus der Geschäftstätigkeit	$ 88	$ 3.795	$ 4.907

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

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

Mortgage Opportunities Fund		StocksPLUS™ Fund		PIMCO StocksPLUS™ AR Fund		Strategic Income Fund	
Am 30. Jun. 2023 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2023 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2023 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2023 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum
$ 23.325	$ 34.884	$ 31.119	$ 15.113	$ 207	$ 60	$ 12.823	$ 12.792
6	0	36	0	0	0	0	0
(58.626)	(28.024)	(16.459)	(21.446)	(46)	48	(6.895)	687
10.480	1.021	109.846	(405.427)	686	(1.276)	10.817	(26.297)
(1.185)	(3.948)	(370)	(4.976)	(22)	0	(522)	71
66.020	(168.883)	24.785	(112.687)	13	(491)	11.162	(69.048)
(11.895)	(53.916)	85.329	(176.311)	886	(1.236)	(3.915)	(13.662)
1.457	108	8	(31)	0	(1)	264	(54)
29.582	(218.758)	234.294	(705.765)	1.724	(2.896)	23.734	(95.511)
(2.614)	(5.633)	(4.906)	(8.247)	(36)	(37)	(3.208)	(4.005)
(44)	(70)	(37)	(25)	0	0	0	0
(4)	0	0	0	0	0	0	0
0	(1)	(5)	(3)	0	0	(46)	(55)
(2.662)	(5.704)	(4.948)	(8.275)	(36)	(37)	(3.254)	(4.060)
0	0	0	0	1	1	0	0
(2.662)	(5.704)	(4.948)	(8.275)	(35)	(36)	(3.254)	(4.060)
26.920	(224.462)	229.346	(714.040)	1.689	(2.932)	20.480	(99.571)
(7.636)	(765)	(184)	(26)	0	0	(117)	(144)
0	0	0	0	0	0	0	0
(1.407)	(5.834)	(434)	(41)	0	0	(2.691)	(2.798)
(450)	16	7	(2)	0	0	(62)	(22)
(9.493)	(6.583)	(611)	(69)	0	0	(2.870)	(2.964)
17.427	(231.045)	228.735	(714.109)	1.689	(2.932)	17.610	(102.535)
0	0	1	11	0	0	(704)	(557)
0	0	0	0	0	0	(5)	(2)
17.427	(231.045)	228.736	(714.098)	1.689	(2.932)	16.901	(103.094)
$ 17.427	$ (231.045)	$ 228.736	$ (714.098)	$ 1.689	$ (2.932)	$ 16.901	$ (103.094)

Aufwands- und Ertragsrechnung (Forts.)

(Angaben in Tausend)	Total Return Bond Fund		PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund	
	Am 30. Jun. 2023 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2023 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum
Erträge				
Zins- und Dividendenerträge	$ 84.744	$ 49.726	$ 9.305	$ 326
Sonstige Erträge	4.080	0	0	0
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus übertragbaren Wertpapieren, Investmentfonds, Pensionsgeschäften und Einlagen bei Kreditinstituten	(54.618)	(191.151)	2.055	(3.031)
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus derivativen Finanzinstrumenten	(7.773)	45.966	(28.724)	11.123
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Fremdwährung	(2.910)	(13.223)	(1.749)	(581)
Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus übertragbaren Wertpapieren, Investmentfonds, Pensionsgeschäften und Einlagen bei Kreditinstituten	117.352	(569.169)	(6.449)	(1.506)
Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus derivativen Finanzinstrumenten	(29.541)	(31.153)	15.082	6.647
Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus Fremdwährung	219	(293)	95	291
Gesamtanlageertrag/(-verlust)	111.553	(709.297)	(10.385)	13.269
Betriebskosten				
Verwaltungsgebühr	(16.143)	(16.840)	(2.635)	(711)
Servicegebühr	(873)	(682)	(5)	0
Bestandspflegegebühr	(446)	(351)	0	0
Sonstige Aufwendungen	(20)	(21)	0	0
Gesamtaufwendungen	(17.482)	(17.894)	(2.640)	(711)
Erstattungen der Anlageberatungsgesellschaft	0	512	44	4
Betriebskosten, netto	(17.482)	(17.382)	(2.596)	(707)
Anlageerträge/(-verluste), netto	94.071	(726.679)	(12.981)	12.562
Finanzierungskosten				
Zinsaufwendungen	(500)	(522)	(216)	(31)
Aufwand für Kreditfazilitäten	0	0	0	0
Ausschüttungen an rückgabe- und gewinnberechtigte Anteilinhaber	(10.113)	(7.363)	(1.312)	0
Nettoausgleichskredite und -gebühren	(16)	6	12	0
Summe Finanzierungskosten	(10.629)	(7.879)	(1.516)	(31)
Gewinne/(Verluste) im Berichtszeitraum vor Steuern	83.442	(734.558)	(14.497)	12.531
Quellensteuern auf Dividenden und sonstige Anlageerträge	(192)	3	0	0
Kapitalertragsteuer	0	0	0	0
Gewinne/(Verluste) im Berichtszeitraum nach Steuern	83.250	(734.555)	(14.497)	12.531
Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens der rücknahme- und gewinnberechtigten Anteilinhaber aus der Geschäftstätigkeit	$ 83.250	$ (734.555)	$ (14.497)	$ 12.531

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

UK Corporate Bond Fund		UK Long Term Corporate Bond Fund		US High Yield Bond Fund		US Investment Grade Corporate Bond Fund	
Am 30. Jun. 2023 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2023 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2023 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2023 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum
£ 7.122	£ 5.780	£ 6.796	£ 5.441	$ 61.723	$ 89.165	$ 9.367	$ 11.166
30	0	83	0	365	0	0	0
(8.084)	(6.552)	(13.392)	(13.229)	(62.031)	(14.111)	(4.417)	(54.490)
4.123	(7.824)	2.534	(12.538)	12.692	(48.533)	1.316	(27.266)
(10)	(76)	27	39	42	(1.248)	210	(521)
(3.359)	(65.594)	(2.332)	(69.491)	107.278	(580.152)	8.433	(69.863)
(2.489)	(2.182)	(1.462)	(3.480)	(2.449)	(25.796)	3.982	(18.953)
(65)	33	(31)	(18)	(33)	(29)	(65)	74
(2.732)	(76.415)	(7.777)	(93.276)	117.587	(580.704)	18.826	(159.853)
(671)	(1.069)	(721)	(879)	(6.895)	(10.592)	(1.212)	(1.722)
0	0	0	0	(471)	(722)	0	0
0	0	0	0	0	0	0	0
0	0	0	0	(1)	(2)	0	0
(671)	(1.069)	(721)	(879)	(7.367)	(11.316)	(1.212)	(1.722)
5	2	0	0	0	0	0	0
(666)	(1.067)	(721)	(879)	(7.367)	(11.316)	(1.212)	(1.722)
(3.398)	(77.482)	(8.498)	(94.155)	110.220	(592.020)	17.614	(161.575)
(317)	(115)	(141)	(39)	(151)	0	(36)	(28)
0	0	0	0	(254)	(240)	0	0
(3.656)	(3.974)	(797)	(700)	(10.534)	(15.889)	(1.917)	(4.678)
(161)	24	(7)	(1)	115	46	89	(996)
(4.134)	(4.065)	(945)	(740)	(10.824)	(16.083)	(1.864)	(5.702)
(7.532)	(81.547)	(9.443)	(94.895)	99.396	(608.103)	15.750	(167.277)
0	6	0	0	0	(22)	(39)	(29)
0	0	0	0	0	0	0	0
(7.532)	(81.541)	(9.443)	(94.895)	99.396	(608.125)	15.711	(167.306)
£ (7.532)	£ (81.541)	£ (9.443)	£ (94.895)	$ 99.396	$ (608.125)	$ 15.711	$ (167.306)

Aufwands- und Ertragsrechnung (Forts.)

(Angaben in Tausend)	US Short-Term Fund		Summe der Gesellschaft*	
	Am 30. Jun. 2023 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2023 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum
Erträge				
Zins- und Dividendenerträge	$ 47.173	$ 20.765	$ 3.621.191	$ 3.018.223
Sonstige Erträge	0	0	23.737	0
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus übertragbaren Wertpapieren, Investmentfonds, Pensionsgeschäften und Einlagen bei Kreditinstituten	(28.034)	(32.581)	(3.311.905)	(3.410.275)
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus derivativen Finanzinstrumenten	2.688	32.774	833.179	(873.460)
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Fremdwährung	(876)	(616)	(90.477)	(362.866)
Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus übertragbaren Wertpapieren, Investmentfonds, Pensionsgeschäften und Einlagen bei Kreditinstituten	44.606	(98.443)	3.658.223	(24.536.624)
Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus derivativen Finanzinstrumenten	(3.479)	21.526	744.967	(3.331.411)
Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus Fremdwährung	(18)	(105)	47.262	16.998
Gesamtanlageertrag/(-verlust)	62.060	(56.680)	5.526.177	(29.479.415)
Betriebskosten				
Verwaltungsgebühr	(4.354)	(5.191)	(660.693)	(758.453)
Servicegebühr	(24)	(29)	(11.708)	(14.153)
Bestandspflegegebühr	0	0	(19.017)	(19.242)
Sonstige Aufwendungen	(1)	(1)	(2.639)	(2.927)
Gesamtaufwendungen	(4.379)	(5.221)	(694.057)	(794.775)
Erstattungen der Anlageberatungsgesellschaft	371	443	5.159	6.853
Betriebskosten, netto	(4.008)	(4.778)	(688.898)	(787.922)
Anlageerträge/(-verluste), netto	58.052	(61.458)	4.837.279	(30.267.337)
Finanzierungskosten				
Zinsaufwendungen	(231)	(747)	(92.810)	(16.747)
Aufwand für Kreditfazilitäten	0	0	(604)	(553)
Ausschüttungen an rückgabe- und gewinnberechtigte Anteilinhaber	(15.308)	(5.821)	(1.342.840)	(1.111.604)
Nettoausgleichskredite und -gebühren	(44)	(13)	(7.256)	(14.711)
Summe Finanzierungskosten	(15.583)	(6.581)	(1.443.510)	(1.143.615)
Gewinne/(Verluste) im Berichtszeitraum vor Steuern	42.469	(68.039)	3.393.769	(31.410.952)
Quellensteuern auf Dividenden und sonstige Anlageerträge	0	(18)	(14.296)	(11.872)
Kapitalertragsteuer	0	0	(1.134)	(282)
Gewinne/(Verluste) im Berichtszeitraum nach Steuern	42.469	(68.057)	3.378.339	(31.423.106)
Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens der rücknahme- und gewinnberechtigten Anteilinhaber aus der Geschäftstätigkeit	$ 42.469	$ (68.057)	$ 3.378.339	$ (31.423.106)

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

* Die Summe der Gesellschaft für die Berichtszeiträume zum 30. Juni 2023 und zum 30. Juni 2022 wurde bereinigt, um Überkreuzinvestitionen zu eliminieren. Nähere Einzelheiten zu Überkreuzinvestitionen sind Erläuterung 10 in den Erläuterungen zum Abschluss zu entnehmen.

(Diese Seite wurde absichtlich freigelassen.)

Ausweis der Nettovermögensänderungen

(Angaben in Tausend)	PIMCO Asia High Yield Bond Fund		Asia Strategic Interest Bond Fund		PIMCO Capital Securities Fund	
	Am 30. Jun. 2023 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2023 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2023 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum
Nettovermögen zu Beginn des Berichtszeitraums	$ 2.981.392	$ 3.411.923	$ 313.987	$ 361.011	$ 5.721.591	$ 9.110.409
Erlöse aus ausgegebenen Anteilen	461.927	1.624.590	64.256	63.208	1.152.469	1.061.822
Erlöse aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	2.598	4.497	681	316	4.901	5.034
Zahlungen für zurückgenommene Anteile	(621.025)	(1.208.330)	(57.745)	(49.053)	(1.317.218)	(2.725.487)
Nominalwechselkursanpassungen	0	0	0	0	0	0
Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens der rücknahme- und gewinnberechtigten Anteilinhaber aus der Geschäftstätigkeit	(28.721)	(801.554)	(1.360)	(62.908)	(111.741)	(1.500.717)
Nettovermögen zum Ende des Berichtszeitraums	$ 2.796.171	$ 3.031.126	$ 319.819	$ 312.574	$ 5.450.002	$ 5.951.061

	Diversified Income Duration Hedged Fund		Diversified Income ESG Fund[1]	Dynamic Bond Fund	
	Am 30. Jun. 2023 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2023 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2023 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum
Nettovermögen zu Beginn des Berichtszeitraums	$ 564.684	$ 1.305.365	$ 9.854	$ 3.483.601	$ 3.277.997
Erlöse aus ausgegebenen Anteilen	16.092	37.493	50.269	187.421	312.414
Erlöse aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	25	14	0	705	747
Zahlungen für zurückgenommene Anteile	(91.148)	(315.292)	(1.754)	(513.546)	(721.606)
Nominalwechselkursanpassungen	0	0	0	0	0
Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens der rücknahme- und gewinnberechtigten Anteilinhaber aus der Geschäftstätigkeit	31.914	(217.427)	(380)	209.112	(433.724)
Nettovermögen zum Ende des Berichtszeitraums	$ 521.567	$ 810.153	$ 57.989	$ 3.367.293	$ 2.435.828

	Emerging Markets Bond ESG Fund		Emerging Markets Corporate Bond Fund		PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund	
	Am 30. Jun. 2023 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2023 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2023 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum
Nettovermögen zu Beginn des Berichtszeitraums	$ 2.492.475	$ 2.635.769	$ 168.986	$ 212.894	$ 205.131	$ 290.475
Erlöse aus ausgegebenen Anteilen	298.339	948.977	3.563	11.490	38.588	64.474
Erlöse aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	527	962	0	0	22	7
Zahlungen für zurückgenommene Anteile	(522.493)	(652.057)	(16.892)	(21.579)	(24.892)	(41.842)
Nominalwechselkursanpassungen	0	0	0	0	0	0
Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens der rücknahme- und gewinnberechtigten Anteilinhaber aus der Geschäftstätigkeit	93.485	(736.449)	4.076	(47.833)	11.719	(44.072)
Nettovermögen zum Ende des Berichtszeitraums	$ 2.362.333	$ 2.197.202	$ 159.733	$ 154.972	$ 230.568	$ 269.042

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

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

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

PIMCO Climate Bond Fund		Commodity Real Return Fund		PIMCO Credit Opportunities Bond Fund		Diversified Income Fund	
Am 30. Jun. 2023 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2023 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2023 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2023 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum
$ 292.655	$ 328.081	$ 1.369.877	$ 1.444.182	$ 97.153	$ 139.704	$ 8.751.796	$ 16.447.733
95.287	71.635	235.884	1.074.681	4.461	5.489	888.864	1.118.430
2	136	0	0	0	0	7.326	10.732
(106.394)	(54.800)	(518.107)	(859.208)	(5.449)	(8.275)	(1.974.800)	(4.099.599)
0	0	0	0	0	0	0	0
7.974	(70.877)	(114.488)	152.570	3.631	(15.973)	269.531	(3.407.294)
$ 289.524	$ 274.175	$ 973.166	$ 1.812.225	$ 99.796	$ 120.945	$ 7.942.717	$ 10.070.002

Dynamic Multi-Asset Fund		Emerging Local Bond Fund		Emerging Local Bond ESG Fund[2]	Emerging Markets Bond Fund	
Am 30. Jun. 2023 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2023 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2023 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2023 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum
€ 5.115.170	€ 7.635.950	$ 1.919.668	$ 2.151.129	$ 6.609	$ 3.305.979	$ 4.714.744
263.195	557.167	1.046.430	490.111	446	493.414	982.073
35	49	1.071	999	2	1.331	2.131
(1.054.085)	(1.367.212)	(376.800)	(499.751)	0	(544.652)	(1.467.932)
0	0	0	0	0	0	0
(66.104)	(744.226)	195.074	(289.605)	635	133.575	(1.016.879)
€ 4.258.211	€ 6.081.728	$ 2.785.443	$ 1.852.883	$ 7.692	$ 3.389.647	$ 3.214.137

Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund		PIMCO ESG Income Fund		Euro Bond Fund		Euro Credit Fund	
Am 30. Jun. 2023 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2023 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2023 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2023 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum
$ 20.937	$ 29.760	$ 237.961	$ 125.087	€ 1.913.275	€ 2.574.129	€ 610.008	€ 1.017.163
2.533	7.100	109.092	72.168	242.427	211.134	84.231	246.063
0	0	432	95	0	0	0	235
(4.403)	(9.015)	(93.899)	(23.835)	(444.809)	(444.326)	(101.995)	(315.369)
0	0	0	0	0	0	0	0
1.016	(2.216)	1.106	(22.375)	42.668	(285.534)	17.695	(143.944)
$ 20.083	$ 25.629	$ 254.692	$ 151.140	€ 1.753.561	€ 2.055.403	€ 609.939	€ 804.148

Aufstellung über die Nettovermögensänderungen (Forts.)

(Angaben in Tausend)	Euro Income Bond Fund		Euro Long Average Duration Fund		Euro Short-Term Fund	
	Am 30. Jun. 2023 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2023 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2023 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum
Nettovermögen zu Beginn des Berichtszeitraums	€ 1.352.980	€ 2.482.304	€ 110.048	€ 160.601	€ 353.095	€ 629.859
Erlöse aus ausgegebenen Anteilen	130.742	357.731	362.362	18.010	23.762	32.982
Erlöse aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	13	987	0	0	0	0
Zahlungen für zurückgenommene Anteile	(249.609)	(944.650)	(26.818)	(21.658)	(167.912)	(145.195)
Nominalwechselkursanpassungen	0	0	0	0	0	0
Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens der rücknahme- und gewinnberechtigten Anteilinhaber aus der Geschäftstätigkeit	28.044	(285.965)	4.373	(41.742)	4.414	(10.387)
Nettovermögen zum Ende des Berichtszeitraums	€ 1.262.170	€ 1.610.407	€ 449.965	€ 115.211	€ 213.359	€ 507.259

	Global Bond ESG Fund		Global Bond Ex-US Fund		PIMCO Global Core Asset Allocation Fund	
	Am 30. Jun. 2023 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2023 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2023 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum
Nettovermögen zu Beginn des Berichtszeitraums	$ 3.106.190	$ 2.302.966	$ 716.022	$ 911.707	$ 750.076	$ 1.035.021
Erlöse aus ausgegebenen Anteilen	814.491	589.111	79.619	178.248	39.784	121.244
Erlöse aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	3.499	1.948	454	348	4	3
Zahlungen für zurückgenommene Anteile	(627.987)	(294.593)	(88.472)	(271.535)	(167.583)	(146.305)
Nominalwechselkursanpassungen	0	0	0	0	0	0
Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens der rücknahme- und gewinnberechtigten Anteilinhaber aus der Geschäftstätigkeit	48.641	(421.558)	22.953	(85.130)	46.306	(230.671)
Nettovermögen zum Ende des Berichtszeitraums	$ 3.344.834	$ 2.177.874	$ 730.576	$ 733.638	$ 668.587	$ 779.292

	Global Real Return Fund		Income Fund		Income Fund II	
	Am 30. Jun. 2023 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2023 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2023 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum
Nettovermögen zu Beginn des Berichtszeitraums	$ 2.571.862	$ 3.703.379	$ 57.980.327	$ 73.579.726	$ 56.623	$ 27.770
Erlöse aus ausgegebenen Anteilen	270.535	511.183	13.763.965	9.993.226	86.951	9.537
Erlöse aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	1.724	2.840	77.852	53.873	17	42
Zahlungen für zurückgenommene Anteile	(384.549)	(783.240)	(8.234.205)	(16.972.510)	(46.148)	(1.548)
Nominalwechselkursanpassungen	0	0	0	0	0	0
Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens der rücknahme- und gewinnberechtigten Anteilinhaber aus der Geschäftstätigkeit	51.097	(637.099)	939.628	(9.797.148)	274	(3.724)
Nettovermögen zum Ende des Berichtszeitraums	$ 2.510.669	$ 2.797.063	$ 64.527.567	$ 56.857.167	$ 97.717	$ 32.077

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

PIMCO European High Yield Bond Fund		PIMCO European Short-Term Opportunities Fund		Global Advantage Fund		Global Bond Fund	
Am 30. Jun. 2023 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2023 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2023 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2023 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum
€ 174.162	€ 170.489	€ 211.172	€ 395.491	$ 410.459	$ 521.067	$ 11.420.112	$ 14.038.846
108.227	6.506	25.909	53.364	2.120	14.290	3.108.542	1.829.723
0	0	0	0	0	0	1.646	1.567
(65.889)	(9.060)	(90.342)	(163.937)	(6.904)	(20.204)	(2.235.847)	(2.625.242)
0	0	0	0	0	0	0	0
8.173	(23.950)	1.139	(11.240)	5.940	(79.542)	317.257	(1.919.147)
€ 224.673	€ 143.985	€ 147.878	€ 273.678	$ 411.615	$ 435.611	$ 12.611.710	$ 11.325.747

Global High Yield Bond Fund		Global Investment Grade Credit Fund		Global Investment Grade Credit ESG Fund		Global Low Duration Real Return Fund	
Am 30. Jun. 2023 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2023 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2023 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2023 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum
$ 3.102.868	$ 5.169.160	$ 10.538.341	$ 17.154.925	$ 1.369.890	$ 1.189.563	$ 1.364.375	$ 1.199.076
494.510	751.865	2.744.657	2.112.051	754.616	866.139	254.055	346.002
1.377	1.143	2.085	2.628	12	308	13	0
(675.051)	(1.438.485)	(3.174.827)	(5.254.660)	(327.768)	(282.014)	(387.573)	(470.577)
0	0	0	0	0	0	0	0
146.132	(959.273)	382.595	(2.997.637)	22.599	(347.500)	22.287	(92.273)
$ 3.069.836	$ 3.524.410	$ 10.492.851	$ 11.017.307	$ 1.819.349	$ 1.426.496	$ 1.253.157	$ 982.228

Inflation Multi-Asset Fund		Low Average Duration Fund		Low Duration Global Investment Grade Credit Fund		Low Duration Income Fund	
Am 30. Jun. 2023 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2023 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2023 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2023 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum
$ 403.078	$ 164.345	$ 1.072.758	$ 1.179.138	$ 654.749	$ 806.869	$ 1.084.380	$ 1.367.475
13.707	396.530	71.088	1.094.731	159.600	88.461	437.266	469.983
73	102	306	131	172	101	58	25
(95.829)	(50.789)	(267.387)	(628.372)	(35.036)	(111.063)	(132.106)	(618.274)
0	0	0	0	0	0	0	0
3.149	(39.007)	9.247	(69.192)	18.732	(105.832)	65.787	(188.689)
$ 324.178	$ 471.181	$ 886.012	$ 1.576.436	$ 798.217	$ 678.536	$ 1.455.385	$ 1.030.520

Aufstellung über die Nettovermögensänderungen (Forts.)

(Angaben in Tausend)	Low Duration Opportunities Fund		Low Duration Opportunities ESG Fund[3]	PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund	
	Am 30. Jun. 2023 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2023 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2023 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum
Nettovermögen zu Beginn des Berichtszeitraums	$ 1.345.781	$ 3.217.260	$ 4.928	$ 120.137	$ 100.538
Erlöse aus ausgegebenen Anteilen	248.767	779.899	0	4.956	62.957
Erlöse aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	1.437	396	1	2	3
Zahlungen für zurückgenommene Anteile	(552.650)	(414.455)	0	(31.799)	(47.316)
Nominalwechselkursanpassungen	0	0	0	0	0
Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens der rücknahme- und gewinnberechtigten Anteilinhaber aus der Geschäftstätigkeit	78.042	(561.779)	88	3.795	4.907
Nettovermögen zum Ende des Berichtszeitraums	$ 1.121.377	$ 3.021.321	$ 5.017	$ 97.091	$ 121.089

	Total Return Bond Fund		PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund		UK Corporate Bond Fund	
	Am 30. Jun. 2023 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2023 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2023 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum
Nettovermögen zu Beginn des Berichtszeitraums	$ 4.150.717	$ 4.944.898	$ 435.924	$ 101.789	£ 389.173	£ 592.164
Erlöse aus ausgegebenen Anteilen	670.578	577.403	111.465	21.844	35.847	56.101
Erlöse aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	5.200	4.094	4	0	0	0
Zahlungen für zurückgenommene Anteile	(583.376)	(727.420)	(230.532)	(12.472)	(82.653)	(61.666)
Nominalwechselkursanpassungen	0	0	0	0	0	0
Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens der rücknahme- und gewinnberechtigten Anteilinhaber aus der Geschäftstätigkeit	83.250	(734.555)	(14.497)	12.531	(7.532)	(81.541)
Nettovermögen zum Ende des Berichtszeitraums	$ 4.326.369	$ 4.064.420	$ 302.364	$ 123.692	£ 334.835	£ 505.058

	Summe der Gesellschaft*	
	Am 30. Jun. 2023 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum
Nettovermögen zu Beginn des Berichtszeitraums	$ 151.524.519	$ 209.342.798
Erlöse aus ausgegebenen Anteilen	32.330.533	33.462.234
Erlöse aus Wiederanlagen von Ausschüttungen	131.146	110.788
Zahlungen für zurückgenommene Anteile	(29.325.755)	(53.479.245)
Nominalwechselkursanpassungen	265.492	(1.324.437)
Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens der rücknahme- und gewinnberechtigten Anteilinhaber aus der Geschäftstätigkeit	3.378.339	(31.423.106)
Nettovermögen zum Ende des Berichtszeitraums	$ 158.304.274	$ 156.689.032

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

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

* Die Summe der Gesellschaft für die Berichtszeiträume zum 30. Juni 2023 und zum 30. Juni 2022 wurde bereinigt, um Überkreuzinvestitionen zu eliminieren. Nähere Einzelheiten zu Überkreuzinvestitionen sind Erläuterung 10 in den Erläuterungen zum Abschluss zu entnehmen.

Mortgage Opportunities Fund		StocksPLUS™ Fund		PIMCO StocksPLUS™ AR Fund		Strategic Income Fund	
Am 30. Jun. 2023 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2023 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2023 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2023 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum
$ 849.148	$ 2.238.424	$ 1.008.739	$ 3.761.156	$ 9.528	$ 11.610	$ 506.557	$ 619.928
82.072	880.678	825.580	538.574	1.073	1.393	20.350	131.886
198	2.537	429	41	0	0	13	5
(328.509)	(1.283.324)	(259.525)	(1.969.507)	(743)	(299)	(81.885)	(119.881)
0	0	0	0	0	0	0	0
17.427	(231.045)	228.736	(714.098)	1.689	(2.932)	16.901	(103.094)
$ 620.336	$ 1.607.270	$ 1.803.959	$ 1.616.166	$ 11.547	$ 9.772	$ 461.936	$ 528.844

UK Long Term Corporate Bond Fund		US High Yield Bond Fund		US Investment Grade Corporate Bond Fund		US Short-Term Fund	
Am 30. Jun. 2023 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2023 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2023 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2023 abgeschlossener Berichtszeitraum	Am 30. Jun. 2022 abgeschlossener Berichtszeitraum
£ 325.020	£ 425.748	$ 1.984.922	$ 3.923.786	$ 388.522	$ 878.100	$ 2.310.115	$ 2.650.198
1.886	34.072	289.270	548.535	144.702	92.249	328.573	845.504
1	1	1.930	3.080	30	3.268	12.934	5.244
(19.552)	(66.070)	(397.917)	(1.392.766)	(104.172)	(398.841)	(627.187)	(953.204)
0	0	0	0	0	0	0	0
(9.443)	(94.895)	99.396	(608.125)	15.711	(167.306)	42.469	(68.057)
£ 297.912	£ 298.856	$ 1.977.601	$ 2.474.510	$ 444.793	$ 407.470	$ 2.066.904	$ 2.479.685

Aufstellung des Wertpapierbestands des PIMCO Asia High Yield Bond Fund

BESCHREIBUNG		PAR (000S)		MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE					
AUSTRALIEN					
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL					
Emeco Pty. Ltd.					
6,250 % fällig am 10.07.2026	AUD	11.810	$	7.313	0,26
Mineral Resources Ltd.					
8,000 % fällig am 01.11.2027	$	16.040		16.034	0,57
8,125 % fällig am 01.05.2027		4.996		5.001	0,18
Summe Australien				28.348	1,01
BRASILIEN					
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL					
CSN Resources S.A.					
4,625 % fällig am 10.06.2031		5.000		3.822	0,14
CAYMAN INSELN					
WANDELANLEIHEN & WECHSEL					
Hansoh Pharmaceutical Group Co. Ltd.					
0,000 % fällig am 22.01.2026 (c)		12.100		11.637	0,41
Meituan					
0,000 % fällig am 27.04.2028 (c)		14.200		11.679	0,42
Wynn Macau Ltd.					
4,500 % fällig am 07.03.2029		10.900		11.931	0,43
				35.247	1,26
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL					
AAC Technologies Holdings, Inc.					
3,000 % fällig am 27.11.2024		14.730		13.956	0,50
Agile Group Holdings Ltd.					
5,500 % fällig am 21.04.2025		14.195		3.643	0,13
5,500 % fällig am 17.05.2026		34.510		7.342	0,26
5,750 % fällig am 02.01.2025		4.000		1.230	0,04
6,050 % fällig am 13.10.2025		13.170		3.156	0,11
7,875 % fällig am 31.07.2024 (e)		6.077		800	0,03
China Hongqiao Group Ltd.					
6,250 % fällig am 08.06.2024		16.900		16.623	0,59
China Modern Dairy Holdings Ltd.					
2,125 % fällig am 14.07.2026		23.100		19.791	0,71
China SCE Group Holdings Ltd.					
5,950 % fällig am 29.09.2024		3.900		682	0,02
6,000 % fällig am 04.02.2026		10.150		1.218	0,04
7,000 % fällig am 02.05.2025		19.400		2.813	0,10
CIFI Holdings Group Co. Ltd.					
5,250 % fällig am 13.05.2026 ^		1.752		203	0,01
5,950 % fällig am 20.10.2025 ^		5.867		680	0,02
6,450 % fällig am 07.11.2024 ^		16.695		1.963	0,07
6,550 % fällig am 28.03.2024 ^		3.098		364	0,01
Country Garden Holdings Co. Ltd.					
2,700 % fällig am 12.07.2026		13.400		4.103	0,15
3,125 % fällig am 22.10.2025		19.580		6.171	0,22
3,875 % fällig am 22.10.2030		24.644		7.047	0,25
4,200 % fällig am 06.02.2026		18.000		5.739	0,21
4,800 % fällig am 06.08.2030		8.300		2.404	0,09
5,125 % fällig am 14.01.2027		38.100		12.069	0,43
5,400 % fällig am 27.05.2025		8.090		2.996	0,11
5,625 % fällig am 15.12.2026		2.000		675	0,02
6,150 % fällig am 17.09.2025		10.100		3.338	0,12
6,500 % fällig am 08.04.2024		6.000		3.562	0,13
7,250 % fällig am 08.04.2026		31.420		11.054	0,40
8,000 % fällig am 27.01.2024		9.100		5.980	0,21
eHi Car Services Ltd.					
7,000 % fällig am 21.09.2026		12.450		7.496	0,27
7,750 % fällig am 14.11.2024		10.300		8.115	0,29
FWD Group Ltd.					
5,750 % fällig am 09.07.2024		200		197	0,01
6,375 % fällig am 13.09.2024 (e)		2.570		2.301	0,08
8,045 % fällig am 15.12.2023 (e)		4.300		3.909	0,14
FWD Ltd.					
5,000 % fällig am 24.09.2024		200		196	0,01
Health & Happiness International Holdings Ltd.					
13,500 % fällig am 26.06.2026		25.635		24.271	0,87
Kaisa Group Holdings Ltd.					
8,500 % fällig am 30.06.2022 ^		17.900		1.197	0,04
9,375 % fällig am 30.06.2024 ^		15.750		1.048	0,04
9,750 % fällig am 28.09.2023 ^		13.200		883	0,03
10,500 % fällig am 15.01.2025 ^		20.200		1.351	0,05
10,875 % fällig am 23.07.2023 ^	$	9.800	$	624	0,02
11,250 % fällig am 09.04.2022 ^		6.700		448	0,02
11,700 % fällig am 11.11.2025 ^		1.450		97	0,00
11,950 % fällig am 12.11.2023 ^		12.100		983	0,04
11,950 % fällig am 22.10.2049 ^		800		53	0,00
KWG Group Holdings Ltd.					
5,950 % fällig am 10.08.2025 ^		16.723		1.782	0,06
Melco Resorts Finance Ltd.					
4,875 % fällig am 06.06.2025		36.560		34.867	1,25
5,250 % fällig am 26.04.2026		8.324		7.713	0,28
5,625 % fällig am 17.07.2027		5.450		4.943	0,18
5,750 % fällig am 21.07.2028		47.477		42.017	1,50
MGM China Holdings Ltd.					
4,750 % fällig am 01.02.2027		34.355		31.300	1,12
5,250 % fällig am 18.06.2025		8.500		8.158	0,29
5,875 % fällig am 15.05.2026		3.100		2.957	0,11
New Metro Global Ltd.					
4,500 % fällig am 02.05.2026		5.200		2.197	0,08
6,800 % fällig am 05.08.2023		6.800		6.630	0,24
PCPD Capital Ltd.					
5,125 % fällig am 18.06.2026		3.100		2.480	0,09
Powerlong Real Estate Holdings Ltd.					
5,950 % fällig am 30.04.2025		17.745		1.837	0,07
6,250 % fällig am 10.08.2024		1.130		113	0,00
Sands China Ltd.					
2,800 % fällig am 08.03.2027		6.834		5.937	0,21
3,750 % fällig am 08.08.2031		13.200		10.755	0,38
4,300 % fällig am 08.01.2026		61.160		57.550	2,06
4,875 % fällig am 18.06.2030		13.400		11.941	0,43
5,625 % fällig am 08.08.2025		6.600		6.443	0,23
5,900 % fällig am 08.08.2028		26.300		25.094	0,90
Seazen Group Ltd.					
4,450 % fällig am 13.07.2025		14.100		7.332	0,26
6,000 % fällig am 12.08.2024		14.100		10.074	0,36
Shui On Development Holding Ltd.					
5,500 % fällig am 29.06.2026		12.500		9.293	0,33
Sunac China Holdings Ltd.					
5,950 % fällig am 26.04.2024 ^		3.800		570	0,02
6,500 % fällig am 09.07.2023 ^		13.500		2.095	0,07
6,500 % fällig am 26.01.2026 ^		10.600		1.603	0,06
6,650 % fällig am 03.08.2024 ^		19.400		2.865	0,10
6,800 % fällig am 20.10.2024 ^		12.700		1.952	0,07
7,000 % fällig am 09.07.2025 ^		9.200		1.391	0,05
7,500 % fällig am 01.02.2024 ^		2.000		300	0,01
7,950 % fällig am 11.10.2023 ^		10.000		1.506	0,05
8,350 % fällig am 19.04.2023 ^		19.200		2.839	0,10
Times China Holdings Ltd.					
5,550 % fällig am 04.06.2024 ^		16.400		1.168	0,04
6,200 % fällig am 22.03.2026 ^		8.000		611	0,02
6,600 % fällig am 02.03.2023 ^		7.236		549	0,02
6,750 % fällig am 16.07.2023 ^		2.980		209	0,01
VLL International, Inc.					
5,750 % fällig am 28.11.2024		24.185		23.399	0,84
Wynn Macau Ltd.					
4,875 % fällig am 01.10.2024		10.471		10.221	0,37
5,125 % fällig am 15.12.2029		2.851		2.398	0,09
5,500 % fällig am 15.01.2026		32.544		30.264	1,08
5,500 % fällig am 01.10.2027		19.713		17.569	0,63
5,625 % fällig am 26.08.2028		23.930		20.907	0,75
Zhongsheng Group Holdings Ltd.					
3,000 % fällig am 13.01.2026		2.850		2.599	0,09
				609.199	21,79
Summe Cayman Inseln				644.446	23,05
CHINA					
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL					
Flourish Century					
6,600 % fällig am 04.02.2022 ^(h)		10.900		1.209	0,04
Greenland Global Investment Ltd.					
5,875 % fällig am 03.07.2026		7.150		1.251	0,05
7,250 % fällig am 22.01.2027		18.949		3.127	0,11
New Metro Global Ltd.					
4,625 % fällig am 15.10.2025		4.500		2.273	0,08
4,800 % fällig am 15.12.2024		14.300		9.790	0,35
Yango Group Co. Ltd.					
6,900 % fällig am 31.10.2022 ^	CNY	40.000		292	0,01
Yango Justice International Ltd.					
7,500 % fällig am 15.04.2024 ^	$	17.800	$	374	0,02
7,500 % fällig am 17.02.2025 ^		3.000		26	0,00
7,875 % fällig am 04.09.2024 ^		5.800		87	0,00
8,250 % fällig am 25.11.2023 ^		4.400		66	0,00
9,250 % fällig am 15.04.2023 ^		10.900		95	0,00
Yunda Holding Investment Ltd.					
2,250 % fällig am 19.08.2025		15.600		14.032	0,50
ZhongAn Online P&C Insurance Co. Ltd.					
3,125 % fällig am 16.07.2025		18.180		16.089	0,58
3,500 % fällig am 08.03.2026		2.890		2.500	0,09
Summe China				51.211	1,83
FRANKREICH					
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL					
BNP Paribas S.A.					
7,750 % fällig am 16.08.2029 (e)(g)		4.500		4.367	0,16
9,250 % fällig am 17.11.2027 (e)(g)		4.100		4.235	0,15
Societe Generale S.A.					
9,375 % fällig am 22.11.2027 (e)(g)		8.600		8.428	0,30
Summe Frankreich				17.030	0,61
DEUTSCHLAND					
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL					
Deutsche Bank AG					
4,500 % fällig am 30.11.2026 (e)(g)	€	800		621	0,02
10,000 % fällig am 01.12.2027 (e)(g)		5.600		6.072	0,22
Summe Deutschland				6.693	0,24
HONGKONG					
WANDELANLEIHEN & WECHSEL					
Universe Trek Ltd.					
0,000 % fällig am 15.06.2026 (c)	$	800		776	0,03
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL					
Bank of East Asia Ltd.					
4,000 % fällig am 29.05.2030 (g)		7.300		6.767	0,24
4,875 % fällig am 22.04.2032 (g)		8.400		7.579	0,27
Fortune Star BVI Ltd.					
3,950 % fällig am 02.10.2026	€	14.824		11.159	0,40
5,000 % fällig am 18.05.2026	$	26.100		19.602	0,70
5,050 % fällig am 27.01.2027		8.400		5.817	0,21
5,950 % fällig am 19.10.2025		10.100		8.096	0,29
GLP China Holdings Ltd.					
2,950 % fällig am 29.03.2026		10.250		6.384	0,23
Huarong Finance Co. Ltd.					
3,250 % fällig am 13.11.2024		13.900		13.048	0,47
3,750 % fällig am 29.05.2024		13.500		12.980	0,46
3,875 % fällig am 13.11.2029		25.200		19.460	0,70
4,250 % fällig am 07.11.2027		4.500		3.752	0,13
4,500 % fällig am 29.05.2029		18.500		14.846	0,53
4,625 % fällig am 03.06.2026		3.700		3.298	0,12
4,750 % fällig am 27.04.2027		18.100		15.676	0,56
4,875 % fällig am 22.11.2026		7.180		6.359	0,23
5,000 % fällig am 19.11.2025		13.100		12.097	0,43
6,625 % fällig am 24.02.2025		5.200		4.893	0,18
Sino-Ocean Land Treasure Finance Ltd.					
6,000 % fällig am 30.07.2024		1.000		368	0,01
Sino-Ocean Land Treasure Ltd.					
2,700 % fällig am 13.01.2025		21.200		6.731	0,24
3,250 % fällig am 05.05.2026		32.250		9.964	0,36
4,750 % fällig am 05.08.2029		2.600		531	0,02
4,750 % fällig am 14.01.2030		14.000		2.898	0,10
Yanlord Land HK Co. Ltd.					
5,125 % fällig am 20.05.2026		20.199		16.633	0,59
				208.938	7,47
Summe Hongkong				209.714	7,50
INDIEN					
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL					
Adani Green Energy Ltd.					
4,375 % fällig am 08.09.2024		4.800		4.440	0,16
Adani Green Energy UP Ltd.					
6,250 % fällig am 10.12.2024		12.041		11.557	0,41

BESCHREIBUNG		PAR (000S)		MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
GMR Hyderabad International Airport Ltd.					
4,250 % fällig am 27.10.2027	$	4.878	$	4.323	0,15
4,750 % fällig am 02.02.2026		25.175		24.006	0,86
JSW Hydro Energy Ltd.					
4,125 % fällig am 18.05.2031		18.186		15.360	0,55
Muthoot Finance Ltd.					
4,400 % fällig am 02.09.2023		4.776		4.745	0,17
Periama Holdings LLC					
5,950 % fällig am 19.04.2026		63.700		61.450	2,20
ReNew Wind Energy AP2					
4,500 % fällig am 14.07.2028		30.988		26.438	0,95
Shriram Finance Ltd.					
4,150 % fällig am 18.07.2025		6.956		6.582	0,24
4,400 % fällig am 13.03.2024		36.158		35.383	1,26
Summe Indien				194.284	6,95
INDONESIEN					
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL					
Adaro Indonesia PT					
4,250 % fällig am 31.10.2024		23.174		22.317	0,80
Bank Negara Indonesia Persero Tbk PT					
3,750 % fällig am 30.03.2026 (g)		25.754		23.855	0,85
Bukit Makmur Mandiri Utama PT					
7,750 % fällig am 10.02.2026		23.256		19.884	0,71
Cikarang Listrindo Tbk PT					
4,950 % fällig am 14.09.2026		443		423	0,01
Medco Oak Tree Pte. Ltd.					
7,375 % fällig am 14.05.2026		17.800		17.527	0,63
Minejesa Capital BV					
4,625 % fällig am 10.08.2030		4.700		4.231	0,15
Pakuwon Jati Tbk PT					
4,875 % fällig am 29.04.2028		8.300		7.461	0,27
Saka Energi Indonesia PT					
4,450 % fällig am 05.05.2024		7.900		7.711	0,28
				103.409	3,70
STAATSEMISSIONEN					
Indonesia Government International Bond					
4,650 % fällig am 20.09.2032		21.684		21.280	0,76
Summe Indonesien				124.689	4,46
JAPAN					
WANDELANLEIHEN & WECHSEL					
ANA Holdings, Inc.					
0,000 % fällig am 10.12.2031 (c)	¥	860.000		7.343	0,26
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL					
Asahi Mutual Life Insurance Co.					
6,900 % fällig am 26.01.2028 (e)	$	4.900		4.943	0,18
Summe Japan				12.286	0,44
JERSEY, KANALINSELN					
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL					
West China Cement Ltd.					
4,950 % fällig am 08.07.2026		30.075		23.081	0,82
LUXEMBURG					
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL					
Greensaif Pipelines Bidco SARL					
6,129 % fällig am 23.02.2038		200		205	0,01
Guara Norte SARL					
5,198 % fällig am 15.06.2034		4.421		3.876	0,14
Summe Luxemburg				4.081	0,15
MAURITIUS					
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL					
CA Magnum Holdings					
5,375 % fällig am 31.10.2026		34.160		30.671	1,10
Greenko Dutch BV					
3,850 % fällig am 29.03.2026		9.265		8.340	0,30
Greenko Solar Mauritius Ltd.					
5,550 % fällig am 29.01.2025		9.339		9.024	0,32
5,950 % fällig am 29.07.2026		3.900		3.666	0,13

BESCHREIBUNG		PAR (000S)		MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
Greenko Wind Projects Mauritius Ltd.					
5,500 % fällig am 06.04.2025	$	47.441	$	45.585	1,63
India Airport Infra					
6,250 % fällig am 25.10.2025		3.790		3.672	0,13
India Cleantech Energy					
4,700 % fällig am 10.08.2026		5.127		4.498	0,16
India Green Energy Holdings					
5,375 % fällig am 29.04.2024		28.073		27.451	0,98
India Green Power Holdings					
4,000 % fällig am 22.02.2027		6.102		5.339	0,19
India Toll Roads					
5,500 % fällig am 19.08.2024		27.943		26.999	0,97
Summe Mauritius				165.245	5,91
MEXIKO					
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL					
Banco Mercantil del Norte S.A.					
5,875 % fällig am 24.01.2027 (e)(g)		6.150		5.251	0,19
6,625 % fällig am 24.01.2032 (e)(g)		4.650		3.599	0,13
Summe Mexiko				8.850	0,32
MONGOLEI					
STAATSEMISSIONEN					
Mongolia Government International Bond					
5,125 % fällig am 07.04.2026		22.095		20.603	0,74
8,650 % fällig am 19.01.2028		30.302		30.567	1,09
Summe Mongolei				51.170	1,83
NIEDERLANDE					
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL					
Mong Duong Finance Holdings BV					
5,125 % fällig am 07.05.2029		28.259		24.938	0,89
Prosus NV					
4,193 % fällig am 19.01.2032		15.600		13.145	0,47
4,987 % fällig am 19.01.2052		11.700		8.448	0,30
Summe Niederlande				46.531	1,66
OMAN					
STAATSEMISSIONEN					
Oman Government International Bond					
7,000 % fällig am 25.01.2051		4.600		4.566	0,16
PAKISTAN					
STAATSEMISSIONEN					
Pakistan Government International Bond					
6,000 % fällig am 08.04.2026		55.571		27.230	0,98
6,875 % fällig am 05.12.2027		54.357		26.091	0,93
7,375 % fällig am 08.04.2031		25.300		11.701	0,42
8,250 % fällig am 15.04.2024		1.600		1.160	0,04
8,250 % fällig am 30.09.2025		6.635		3.616	0,13
8,875 % fällig am 08.04.2051		8.200		3.666	0,13
Summe Pakistan				73.464	2,63
PHILIPPINEN					
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL					
ACEN Finance Ltd.					
4,000 % fällig am 08.03.2025 (e)		14.900		10.456	0,37
Globe Telecom, Inc.					
3,000 % fällig am 23.07.2035		8.150		6.134	0,22
4,200 % fällig am 02.08.2026 (e)		24.100		22.443	0,80
ICTSI Treasury BV					
3,500 % fällig am 16.11.2031		2.000		1.741	0,06
Petron Corp.					
4,600 % fällig am 19.07.2023 (e)		2.100		2.095	0,07
5,950 % fällig am 19.04.2026 (e)		6.260		5.822	0,21
Royal Capital BV					
4,875 % fällig am 05.05.2024 (e)		10.571		10.435	0,37
5,000 % fällig am 05.02.2026 (e)		900		875	0,03
San Miguel Corp.					
5,500 % fällig am 29.07.2025 (e)		10.150		9.161	0,33
SMC Global Power Holdings Corp.					
5,450 % fällig am 09.12.2026 (e)		9.875		7.193	0,26
5,700 % fällig am 21.01.2026 (e)		3.754		2.834	0,10
5,950 % fällig am 05.05.2025 (e)		9.000		7.134	0,26

BESCHREIBUNG		PAR (000S)		MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
6,500 % fällig am 25.04.2024 (e)	$	1.750	$	1.566	0,06
7,000 % fällig am 21.10.2025 (e)		16.884		14.183	0,51
Summe Philippinen				102.072	3,65
SINGAPUR					
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL					
Clean Renewable Power Mauritius Pte. Ltd.					
4,250 % fällig am 25.03.2027		6.929		6.089	0,22
GLP Pte. Ltd.					
4,500 % fällig am 17.05.2026 (e)		13.300		4.974	0,18
4,600 % fällig am 29.06.2027 (e)		7.000		2.625	0,09
Indika Energy Capital Pte. Ltd.					
8,250 % fällig am 22.10.2025		19.500		19.417	0,70
Medco Bell Pte. Ltd.					
6,375 % fällig am 30.01.2027		22.200		20.802	0,74
Medco Laurel Tree Pte. Ltd.					
6,950 % fällig am 12.11.2028		2.500		2.296	0,08
TML Holdings Pte. Ltd.					
4,350 % fällig am 09.06.2026		8.000		7.498	0,27
5,500 % fällig am 03.06.2024		13.524		13.375	0,48
Summe Singapur				77.076	2,76
SÜDKOREA					
WANDELANLEIHEN & WECHSEL					
POSCO Holdings, Inc.					
0,000 % fällig am 01.09.2026 (c)	€	7.200		8.062	0,29
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL					
SK Broadband Co. Ltd.					
4,875 % fällig am 28.06.2028	$	12.950		12.770	0,46
SK Hynix, Inc.					
1,500 % fällig am 19.01.2026		4.850		4.299	0,15
2,375 % fällig am 19.01.2031		2.300		1.775	0,06
6,375 % fällig am 17.01.2028		4.900		4.922	0,18
Tongyang Life Insurance Co. Ltd.					
5,250 % fällig am 22.09.2025 (e)		7.300		6.461	0,23
				30.227	1,08
STAATSEMISSIONEN					
Export-Import Bank of Korea					
4,625 % fällig am 07.06.2033		9.000		8.861	0,32
Summe Südkorea				47.150	1,69
SRI LANKA					
STAATSEMISSIONEN					
Sri Lanka Government International Bond					
5,750 % fällig am 18.04.2023 ^		19.512		8.901	0,32
6,200 % fällig am 11.05.2027 ^		23.800		10.958	0,39
6,350 % fällig am 28.06.2024 ^		9.500		4.375	0,16
6,750 % fällig am 18.04.2028 ^		7.000		3.224	0,11
6,825 % fällig am 18.07.2026 ^		4.500		2.132	0,08
6,850 % fällig am 14.03.2024 ^		61.971		28.541	1,02
6,850 % fällig am 03.11.2025 ^		39.900		19.013	0,68
7,550 % fällig am 28.03.2030 ^		8.350		3.844	0,14
7,850 % fällig am 14.03.2029 ^		3.600		1.657	0,06
Summe Sri Lanka				82.645	2,96
THAILAND					
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL					
Bangkok Bank PCL					
5,000 % fällig am 23.09.2025 (e)(g)		21.400		20.300	0,73
Kasikornbank PCL					
3,343 % fällig am 02.10.2031 (g)		3.200		2.828	0,10
5,275 % fällig am 14.10.2025 (e)(g)		28.657		27.089	0,97
Muang Thai Life Assurance PCL					
3,552 % fällig am 27.01.2037 (g)		23.300		20.201	0,72
Summe Thailand				70.418	2,52
GROSSBRITANNIEN					
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL					
Diamond Ltd.					
7,950 % fällig am 28.07.2026		3.700		3.643	0,13
Jaguar Land Rover Automotive PLC					
4,500 % fällig am 15.07.2028	€	6.100		5.833	0,21

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

BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
Standard Chartered PLC			
6,000 % fällig am 26.07.2025 (e)(g)	$ 21.300	$ 20.284	0,73
6,187 % fällig am 06.07.2027 (a)	4.600	4.604	0,16
7,750 % fällig am 15.08.2027 (e)(g)	57.300	56.885	2,03
Vedanta Resources Finance PLC			
8,950 % fällig am 11.03.2025	54.692	41.349	1,48
Summe Großbritannien		132.598	4,74
USA			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Stillwater Mining Co.			
4,000 % fällig am 16.11.2026	2.500	2.233	0,08
US-SCHATZOBLIGATIONEN			
U.S. Treasury Bonds			
1,875 % fällig am 15.11.2051	2.700	1.783	0,06
U.S. Treasury Inflation Protected Securities (d)			
0,125 % fällig am 15.01.2032	49.895	43.949	1,57
		45.732	1,63
Summe USA		47.965	1,71
VIETNAM			
STAATSEMISSIONEN			
Vietnam Debt & Asset Trading Corp.			
1,000 % fällig am 10.10.2025	1.300	1.101	0,04
Vietnam Government International Bond			
5,500 % fällig am 12.03.2028	936	903	0,03
Summe Vietnam		2.004	0,07
JUNGFERNINSELN (BRITISCH)			
WANDELANLEIHEN & WECHSEL			
ADM AG Holding Ltd.			
0,000 % fällig am 26.08.2023 (c)	9.000	8.908	0,32

BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Celestial Miles Ltd.			
5,750 % fällig am 31.01.2024 (e)	$ 26.054	$ 25.730	0,92
Champion Path Holdings Ltd.			
4,500 % fällig am 27.01.2026	17.700	15.648	0,56
Easy Tactic Ltd. (6,500 % bar oder 7,500 % PIK)			
7,500 % fällig am 11.07.2025 (b)	1.600	144	0,01
7,500 % fällig am 11.07.2027 (b)	51.991	4.476	0,16
7,500 % fällig am 11.07.2028 (b)	42.544	3.195	0,11
NWD Finance BVI Ltd.			
4,125 % fällig am 10.03.2028 (e)	24.450	16.611	0,59
4,800 % fällig am 09.09.2023 (e)	6.100	3.603	0,13
5,250 % fällig am 22.03.2026 (e)	25.500	22.478	0,80
6,150 % fällig am 16.03.2025 (e)	45.900	42.802	1,53
Peak RE BVI Holding Ltd.			
5,350 % fällig am 28.10.2025 (e)	8.670	7.196	0,26
RKPF Overseas Ltd.			
5,125 % fällig am 26.07.2026	16.550	7.587	0,27
5,200 % fällig am 12.01.2026	26.100	14.003	0,50
6,000 % fällig am 04.09.2025	5.606	3.214	0,12
Studio City Co. Ltd.			
7,000 % fällig am 15.02.2027	7.000	6.565	0,23
Studio City Finance Ltd.			
5,000 % fällig am 15.01.2029	11.600	8.607	0,31
6,000 % fällig am 15.07.2025	29.132	27.078	0,97
6,500 % fällig am 15.01.2028	2.267	1.896	0,07
Wanda Properties Global Co. Ltd.			
11,000 % fällig am 20.01.2025	7.900	3.514	0,13
11,000 % fällig am 13.02.2026	4.800	2.038	0,07
Wanda Properties International Co. Ltd.			
7,250 % fällig am 29.01.2024	2.000	1.248	0,04
Wanda Properties Overseas Ltd.			
6,875 % fällig am 23.07.2023	1.000	926	0,03
		218.559	7,81
Summe Jungferninseln (Britisch)		227.467	8,13

BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
KURZFRISTIGE INSTRUMENTE			
KURZFRISTIGE SCHULDTITEL			
Yango Justice International Ltd.			
10,250 % fällig am 15.09.2022 ^	$ 4.500	$ 90	0,00
Summe kurzfristige Instrumente		90	0,00
Summe Übertragbare Wertpapiere		**$ 2.458.996**	**87,94**
	AKTIEN		
INVESTMENTFONDS			
ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN			
PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (f)	25.845.662	257.370	9,20
PIMCO Specialty Funds Ireland p.l.c. - PIMCO China Bond Fund (f)	744.048	9.697	0,35
		267.067	9,55
BÖRSENGEHANDELTE FONDS			
PIMCO ETFs plc - PIMCO US Dollar Short Maturity UCITS ETF (f)	48.700	4.837	0,17
Summe Investmentfonds		**$ 271.904**	**9,72**

PENSIONSGESCHÄFTE

Kontrahent	Kredit-zins	Abrechnungs-datum	Fälligkeits-datum	Kapital-betrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensions-geschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensions-geschäft[1]	% des Nettovermögens
SSB	2,400 %	30.06.2023	03.07.2023	$ 7.016	U.S. Treasury Notes 1,875 % fällig am 30.06.2026	$ (7.156)	$ 7.016	$ 7.016	0,25
Summe Pensionsgeschäfte						**$ (7.156)**	**$ 7.016**	**$ 7.016**	**0,25**

[1] Umfasst aufgelaufene Zinsen.

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

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

FUTURES

Beschreibung	Art	Ablauf-monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Euro-Bobl September Futures	Short	09.2023	105	$ 173	0,01
U.S. Treasury 5-Year Note September Futures	Long	09.2023	1.990	(4.156)	(0,15)
U.S. Treasury 10-Year Note September Futures	Long	09.2023	7	(13)	0,00
U.S. Treasury 10-Year Ultra September Futures	Short	09.2023	18	21	0,00
U.S. Treasury 30-Year Bond September Futures	Long	09.2023	638	(78)	0,00
U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond September Futures	Long	09.2023	23	44	0,00
				$ (4.009)	(0,14)
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate				**$ (4.009)**	**(0,14)**

ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)

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

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMMISSIONEN - SCHUTZVERKAUF[1]

Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag[2]	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Jaguar Land Rover Automotive PLC	5,000 %	20.12.2024	€ 5.000	$ 654	0,03
Jaguar Land Rover Automotive PLC	5,000	20.06.2026	2.800	(153)	(0,01)
				$ 501	0,02

ZINSSWAPS

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Erhalt[3]	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,850 %	20.09.2033	¥ 3.800.000	$ (215)	(0,01)
Erhalt[3]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	0,750	16.06.2031	$ 19.400	2.422	0,09
Erhalt[3]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,250	15.12.2026	37.550	3.594	0,13
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,250	15.06.2032	13.500	1.967	0,07
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,500	15.12.2031	28.100	2.197	0,08
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,750	15.06.2024	114.000	(1.703)	(0,06)
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,750	15.12.2051	39.300	4.546	0,16
Zahlung	3-Month KRW-KORIBOR	3,250	15.03.2033	KRW 41.093.606	(312)	(0,01)
Zahlung	3-Month KRW-KORIBOR	3,500	15.03.2028	42.889.600	246	0,01
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	0,750	16.09.2023	$ 19.400	242	0,01
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,250	15.09.2023	37.550	415	0,01
Erhalt[3]	6-Month EUR-EURIBOR	3,000	20.09.2028	€ 4.000	(14)	0,00
					$ 13.385	0,48
Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate					**$ 13.886**	**0,50**

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

(2) Der maximal mögliche Betrag, den der Fonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

(3) Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft.

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

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

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMMISSIONEN - SCHUTZKAUF[1]

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu bezahlender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag[3]	Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Markt-wert	% des Nettovermögens
BOA	Saudi Arabia Government International Bond	(1,000) %	20.06.2028	$ 44.900	$ (648)	$ (230)	$ (878)	(0,03)

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMMISSIONEN - SCHUTZVERKAUF[2]

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag[3]	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Markt-wert	% des Nettovermögens
BPS	Longfor Group Holdings Ltd.	1,000 %	20.06.2026	$ 9.500	$ (155)	$ (968)	$ (1.123)	(0,04)
BRC	BOC Aviation Ltd.	1,000	20.06.2026	24.300	(70)	118	48	0,00
	Vanke Real Estate Hong Kong Co. Ltd.	1,000	20.06.2026	7.400	9	(512)	(503)	(0,02)
CBK	Vietnam Government International Bond	1,000	20.12.2027	9.100	(263)	242	(21)	0,00
					$ (479)	$ (1.120)	$ (1.599)	(0,06)

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

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

(3) Der maximal mögliche Betrag, den der Fonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

ZINSSWAPS

Kontrahent	Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Markt-wert	% des Nettovermögens
GLM	Erhalt	3-Month MYR-KLIBOR	3,545 %	05.05.2028	MYR 127.400	$ 0	$ 150	$ 150	0,01
GST	Erhalt	3-Month MYR-KLIBOR	3,500	15.03.2028	167.250	49	200	249	0,01
						$ 49	$ 350	$ 399	0,02

DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung		Zu erhaltende Währung		Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	08.2023	AUD	10.762	$	7.275	$ 103	$ 0	$ 103	0,00
	08.2023	CNY	12.479		1.818	92	0	92	0,00
	08.2023	€	5.866		6.440	27	0	27	0,00
	08.2023	¥	4.117.200		28.826	158	0	158	0,01
	08.2023	NZD	237		150	5	0	5	0,00
	09.2023	TWD	125.459		4.133	96	0	96	0,00
	09.2023	$	1.808	HKD	14.125	0	(2)	(2)	0,00
	09.2023		20.504	IDR	306.940.703	0	(117)	(117)	0,00
	09.2023		14.664	INR	1.212.899	79	0	79	0,00
BPS	07.2023		13.749	MYR	63.110	0	(202)	(202)	(0,01)
	08.2023	CNY	14.674	$	2.146	116	0	116	0,00
	08.2023	€	1.483		1.590	0	(31)	(31)	0,00
	08.2023	TWD	62.796		2.057	40	0	40	0,00
	08.2023	$	5.239	CNH	36.203	0	(246)	(246)	(0,01)
	08.2023		6.684	€	6.106	0	(9)	(9)	0,00
	09.2023	IDR	1.079.052	$	72	0	0	0	0,00
	09.2023	$	0	THB	1	0	0	0	0,00
BRC	08.2023	€	442	$	476	0	(7)	(7)	0,00
	08.2023	$	2.392	CNH	16.575	0	(106)	(106)	0,00
	08.2023		6.903	¥	913.551	0	(542)	(542)	(0,02)
	09.2023	PHP	462.920	$	8.260	0	(94)	(94)	0,00
CBK	07.2023		1.594.596		29.231	404	0	404	0,02
	08.2023	€	5.301		5.802	7	0	7	0,00
	08.2023	¥	43.700		321	17	0	17	0,00
	08.2023	TWD	65.378		2.142	42	0	42	0,00
	08.2023	$	14	CNH	100	0	(1)	(1)	0,00
	09.2023	PHP	294.148	$	5.253	0	(55)	(55)	0,00
	09.2023	$	13.783	INR	1.133.307	0	(7)	(7)	0,00
DUB	08.2023	CNH	105.760	$	15.033	448	0	448	0,02
GLM	09.2023	TWD	7.303		240	5	0	5	0,00
	09.2023	$	28.324	THB	977.177	0	(555)	(555)	(0,02)
JPM	07.2023	PHP	104.353	$	1.910	23	0	23	0,00
	08.2023	CNH	73.409		10.469	345	0	345	0,01
	08.2023	CNY	15.480		2.264	122	0	122	0,01
	08.2023	$	4.205	CNH	29.061	0	(198)	(198)	(0,01)
	08.2023		1.130	¥	150.136	0	(85)	(85)	0,00
	09.2023	IDR	300.865	$	20	0	0	0	0,00
	09.2023	THB	7.662		223	6	0	6	0,00
	09.2023	$	8.534	IDR	128.395.884	0	(5)	(5)	0,00
	09.2023		54	INR	4.431	0	0	0	0,00
MBC	08.2023	CNH	139.191	$	20.213	1.018	0	1.018	0,04
	08.2023	€	25.777		28.444	263	0	263	0,01
	08.2023	$	314	CNH	2.160	0	(16)	(16)	0,00
MYI	07.2023	£	13	$	16	0	0	0	0,00
	07.2023	IDR	80.913.271		5.410	14	0	14	0,00
	07.2023	$	35	€	32	0	0	0	0,00
	07.2023		186	£	147	1	0	1	0,00
	07.2023		5.385	IDR	80.913.271	12	0	12	0,00
	08.2023	TWD	67.573	$	2.228	58	0	58	0,00
	08.2023	$	14.772	¥	1.963.090	0	(1.103)	(1.103)	(0,04)
	09.2023	IDR	593.736	$	40	0	0	0	0,00
	09.2023	THB	3.492		102	3	0	3	0,00
	09.2023	$	5.410	IDR	80.983.607	0	(32)	(32)	0,00
	09.2023		12	INR	957	0	0	0	0,00
SCX	07.2023		13.783	MYR	63.348	0	(186)	(186)	(0,01)
	08.2023	CNY	41.104	$	6.021	334	0	334	0,01
	08.2023	NZD	84		52	1	0	1	0,00
	08.2023	$	6.229	CNH	43.774	0	(192)	(192)	(0,01)
	08.2023		14.352	TWD	436.304	0	(340)	(340)	(0,01)
	09.2023	IDR	299.775.204	$	20.160	247	0	247	0,01
	09.2023	THB	7.929		230	4	0	4	0,00
	09.2023	TWD	104.832		3.438	66	0	66	0,00
	09.2023	$	34	INR	2.771	0	0	0	0,00
UAG	09.2023	SGD	37.928	$	28.379	273	0	273	0,01
	09.2023	$	13.880	INR	1.147.440	68	0	68	0,00
						$ 4.497	$ (4.131)	$ 366	0,01

ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklassen Institutional AUD (Hedged) ausschüttend und Investor AUD (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung		Zu erhaltende Währung		Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
AZD	07.2023	AUD	355	$	236	$ 0	$ (1)	$ (1)	0,00
	07.2023	$	437	AUD	668	8	0	8	0,00
	08.2023		236		355	1	0	1	0,00
BOA	07.2023		1.370		2.106	33	(1)	32	0,01
BPS	07.2023	AUD	2.029	$	1.342	0	(9)	(9)	0,00
	07.2023	$	1.240	AUD	1.910	32	0	32	0,00
	08.2023		1.206		1.820	6	0	6	0,00
CBK	07.2023		277		425	6	0	6	0,00
SCX	07.2023	AUD	626	$	416	0	(1)	(1)	0,00
	07.2023	$	337	AUD	516	6	0	6	0,00
	08.2023		416		626	1	0	1	0,00
UAG	07.2023	AUD	2.111	$	1.402	2	(6)	(4)	0,00
	07.2023	$	520	AUD	795	9	0	9	0,00
	08.2023		1.403		2.111	7	(3)	4	0,00
						$ 111	$ (21)	$ 90	0,01

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklassen Institutional CHF (Hedged) thesaurierend, Institutional CHF (Hedged) ausschüttend, Class E CHF (Hedged) thesaurierend und Class E CHF (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung		Zu erhaltende Währung		Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BPS	07.2023	CHF	2.058	$	2.301	$ 1	$ 0	$ 1	0,00
	07.2023	$	3.157	CHF	2.857	36	0	36	0,00
	08.2023		2.301		2.052	0	(1)	(1)	0,00
MBC	07.2023		36		32	0	0	0	0,00
MYI	07.2023	CHF	220	$	243	0	(3)	(3)	0,00
	07.2023	$	53	CHF	48	1	0	1	0,00
SCX	07.2023	CHF	32	$	35	0	(1)	(1)	0,00
	07.2023	$	2.156	CHF	1.938	9	0	9	0,00
UAG	07.2023	CHF	2.126	$	2.372	0	(5)	(5)	0,00
	07.2023	$	1.954	CHF	1.756	9	0	9	0,00
	08.2023		2.372		2.120	5	0	5	0,00
						$ 61	$ (10)	$ 51	0,00

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklassen Institutional EUR (Hedged) thesaurierend, Institutional EUR (Hedged) ausschüttend, Investor EUR (Hedged) ausschüttend, Class E EUR (Hedged) thesaurierend und Class E EUR (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung		Zu erhaltende Währung		Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2023	€	2.159	$	2.359	$ 4	$ 0	$ 4	0,00
	07.2023	$	165.988	€	154.450	2.517	0	2.517	0,09
BPS	07.2023	€	171.369	$	187.722	759	(1)	758	0,03
	07.2023	$	166.467	€	154.852	2.477	0	2.477	0,09
	08.2023		174.611		159.137	0	(755)	(755)	(0,03)
CBK	07.2023	€	175.663	$	190.718	2	(933)	(931)	(0,03)
	07.2023	$	55	€	51	0	0	0	0,00
	08.2023		169.171		155.383	584	0	584	0,02
MBC	07.2023	€	1.186	$	1.274	0	(20)	(20)	0,00
	07.2023	$	36.635	€	34.083	550	0	550	0,02
SCX	07.2023	€	6.144	$	6.709	6	0	6	0,00
	07.2023	$	167.108	€	156.151	3.253	0	3.253	0,11
						$ 10.152	$ (1.709)	$ 8.443	0,30

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklassen Institutional GBP (Hedged) thesaurierend und Institutional GBP (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung		Zu erhaltende Währung		Nich t realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2023	£	19	$	24	$ 0	$ 0	$ 0	0,00
BRC	07.2023		0		0	0	0	0	0,00
	07.2023	$	470	£	374	5	0	5	0,00
CBK	07.2023	£	534	$	679	0	0	0	0,00
	07.2023	$	45	£	36	0	0	0	0,00
MBC	07.2023		12.941		10.454	350	0	350	0,01
MYI	07.2023		13.008		10.466	298	0	298	0,01
UAG	07.2023	£	3	$	4	0	0	0	0,00
	07.2023	$	13.374	£	10.733	271	0	271	0,01
						$ 924	$ 0	$ 924	0,03

Zum 30. Juni 2023 standen für die ausschüttende Investor RMB (Hedged) Class die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung		Zu erhaltende Währung		Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2023	$	466	CNH	3.309	$ 0	$ (11)	$ (11)	0,00
BPS	07.2023		465		3.292	0	(12)	(12)	0,00
GLM	07.2023	CNH	3.462	$	477	1	0	1	0,00
	07.2023	$	468	CNH	3.302	0	(14)	(14)	0,00
	08.2023		477		3.454	0	(2)	(2)	0,00
MBC	07.2023		29		204	0	(1)	(1)	0,00
UAG	07.2023		10		71	0	0	0	0,00
						$ 1	$ (40)	$ (39)	0,00

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklassen Institutional SGD (Hedged) Income, Investor SGD (Hedged) Income, E Class SGD (Hedged) Income und M Retail SGD (Hedged) Income II die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung		Zu erhaltende Währung		Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BRC	07.2023	$	6.713	SGD	9.084	$ 0	$ (1)	$ (1)	0,00
GLM	07.2023	SGD	866	$	645	5	0	5	0,00
	07.2023	$	448	SGD	603	0	(3)	(3)	0,00
MBC	07.2023		6.157		8.318	0	(10)	(10)	0,00
	08.2023		20		27	0	0	0	0,00
MYI	07.2023	SGD	9.341	$	6.913	10	0	10	0,00
	08.2023	$	6.764	SGD	9.131	0	(10)	(10)	0,00
SCX	07.2023		1.384		1.874	0	0	0	0,00
UAG	07.2023		6.801		9.198	0	(4)	(4)	0,00
						$ 15	$ (28)	$ (13)	0,00

Summe Freiverkehrsfinanzderivate	**$ 7.744**	**0,28**
Summe Anlagen	**$ 2.755.537**	**98,55**
Sonstige Aktiva und Passiva	**$ 40.634**	**1,45**
Nettovermögen	**$ 2.796.171**	**100,00**

ERLÄUTERUNGEN ZUR AUFSTELLUNG DES WERTPAPIERBESTANDS (Angaben in Tausend*):

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

^ **Das Wertpapier ist in Verzug.**

(a) **Wertpapier per Emissionstermin.**

(b) **Wertpapier mit Sachwertausschüttung.**

(c) **Nullkuponwertpapier.**

(d) **Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.**

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

(f) **Mit dem Fonds verbunden.**

(g) **Bedingt wandelbares Wertpapier.**

(h) **Eingeschränkte Wertpapiere (31. Dezember 2022: 0,04 %):**

Emittentenbeschreibung	Kupon	Fälligkeits-datum	Kauf-datum	Kosten	Markt-wert	% des Nettovermögens
Flourish Century	6,600 %	04.02.2022	25.08.2021 - 27.08.2021	$ 10.747	$ 1.209	0,04

Barmittel in Höhe von 21.139 USD (31. Dezember 2022: 21.668 USD) wurden zum 30. Juni 2023 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Barmittel in Höhe von 2.460 USD (31. Dezember 2022: 12.646 USD) wurden zum 30. Juni 2023 gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. als Sicherheit für Finanzderivate verpfändet.

Beizulegender Zeitwert[1]

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 30. Juni 2023 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie[2]	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	$ 0	$ 2.445.564	$ 13.432	$ 2.458.996
Investmentfonds	271.904	0	0	271.904
Pensionsgeschäfte	0	7.016	0	7.016
Finanzderivate[3]	173	17.448	0	17.621
Summen	**$ 272.077**	**$ 2.470.028**	**$ 13.432**	**$ 2.755.537**

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

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

(1) Siehe Erläuterung 3 in den Erläuterungen zum Abschluss für weitere Informationen.

(2) Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung des Wertpapierbestands.

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

Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC-Finanzderivate und -Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2023 und 31. Dezember 2022:

	Zum 30. Jun. 2023			Zum 31. Dez. 2022		
Kontrahent	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-engagement[1]	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-engagement[1]
AZD	$ 8	$ (20)	$ (12)	$ 1.734	$ (1.360)	$ 374
BOA	2.105	(1.670)	435	(199)	350	151
BPS	1.078	(730)	348	(8.680)	9.734	1.054
BRC	(1.200)	1.210	10	(872)	1.172	300
CBK	45	0	45	4.080	(4.046)	34
DUB	448	(320)	128	1.048	(1.010)	38
GLM	(413)	590	177	96	0	96
GST	249	0	249	(732)	660	(72)
JPM	208	(290)	(82)	(538)	730	192
MBC	2.134	(2.060)	74	4.627	(4.030)	597
MYI	(751)	660	(91)	479	(240)	239
SCX	3.207	(2.920)	287	4.720	(4.520)	200
UAG	626	(610)	16	7.636	(8.540)	(904)

(1) Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären.

Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung des Wertpapierbestands zum 30. Juni 2023:

	30. Jun. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	72,48	70,88
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	15,46	18,07
Investmentfonds	9,72	8,05
Pensionsgeschäfte	0,25	0,69
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	(0,14)	(0,01)
Zentral abgerechnete Finanzderivate	0,50	0,47
Freiverkehrsfinanzderivate	0,28	0,45

Das Anlageportfolio des Fonds konzentriert sich zum 30. Juni 2023 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	30. Jun. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
Australien	1,01	1,12
Brasilien	0,14	0,13
Cayman-Inseln	23,05	26,52
China	1,83	1,91
Frankreich	0,61	0,59
Deutschland	0,24	0,38
Hongkong	7,50	6,10
Indien	6,95	6,45
Indonesien	4,46	3,84
Israel	k. A.	0,09
Japan	0,44	0,24
Jersey, Kanalinseln	0,82	0,84
Luxemburg	0,15	0,13
Mauritius	5,91	7,22
Mexiko	0,32	0,37
Mongolei	1,83	1,30
Niederlande	1,66	1,80
Oman	0,16	0,16
Pakistan	2,63	2,18
Philippinen	3,65	3,53
Singapur	2,76	3,90
Südkorea	1,69	0,20
Sri Lanka	2,96	1,91
Thailand	2,52	2,75
Großbritannien	4,74	3,67
USA	1,71	1,57

Anlagen zum Marktwert	30. Jun. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
Vietnam	0,07	0,21
Jungferninseln (Britisch)	8,13	9,83
Kurzfristige Instrumente	0,00	0,01
Investmentfonds	9,72	8,05
Pensionsgeschäfte	0,25	0,69
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	(0,14)	(0,01)
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	0,02	(0,01)
Credit Default Swaps auf Kreditindizes– Schutzverkauf	k. A.	0,03
Zinsswaps	0,48	0,45
Freiverkehrsfinanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzkauf	(0,03)	(0,09)
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	(0,06)	(0,07)
Zinsswaps	0,02	k. A.
Devisenterminkontrakte	0,01	0,06
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	0,34	0,55
Sonstige Aktiva und Passiva	1,45	1,40
Nettovermögen	100,00	100,00

BESCHREIBUNG		PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE				
AUSTRALIEN				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Emeco Pty. Ltd.				
6,250 % fällig am 10.07.2026	AUD	1.300	$ 805	0,25
Mineral Resources Ltd.				
8,000 % fällig am 01.11.2027	$	1.000	1.000	0,31
8,125 % fällig am 01.05.2027		605	606	0,19
Pacific National Finance Pty. Ltd.				
4,750 % fällig am 22.03.2028		900	818	0,25
Santos Finance Ltd.				
3,649 % fällig am 29.04.2031		600	499	0,16
5,250 % fällig am 13.03.2029		400	376	0,12
Woodside Finance Ltd.				
3,700 % fällig am 15.09.2026		1.600	1.506	0,47
Summe Australien			5.610	1,75
BRASILIEN				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
CSN Resources S.A.				
4,625 % fällig am 10.06.2031		400	306	0,10
CAYMAN INSELN				
WANDELANLEIHEN & WECHSEL				
Hansoh Pharmaceutical Group Co. Ltd.				
0,000 % fällig am 22.01.2026 (c)		900	866	0,27
Meituan				
0,000 % fällig am 27.04.2027 (c)		1.400	1.228	0,38
0,000 % fällig am 27.04.2028 (c)		500	411	0,13
Wynn Macau Ltd.				
4,500 % fällig am 07.03.2029		1.300	1.423	0,45
			3.928	1,23
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
AAC Technologies Holdings, Inc.				
3,000 % fällig am 27.11.2024		1.700	1.611	0,50
3,750 % fällig am 02.06.2031		400	294	0,09
Agile Group Holdings Ltd.				
5,500 % fällig am 17.05.2026		2.500	532	0,17
6,050 % fällig am 13.10.2025		1.500	360	0,11
7,875 % fällig am 31.07.2024 (e)		523	69	0,02
Alibaba Group Holding Ltd.				
2,125 % fällig am 09.02.2031		800	652	0,20
2,700 % fällig am 09.02.2041		1.100	736	0,23
4,500 % fällig am 28.11.2034		900	832	0,26
Baidu, Inc.				
4,375 % fällig am 29.03.2028		1.000	954	0,30
China Hongqiao Group Ltd.				
6,250 % fällig am 08.06.2024		1.400	1.377	0,43
China Modern Dairy Holdings Ltd.				
2,125 % fällig am 14.07.2026		2.200	1.885	0,59
China SCE Group Holdings Ltd.				
5,950 % fällig am 29.09.2024		200	35	0,01
6,000 % fällig am 04.02.2026		200	24	0,01
CIFI Holdings Group Co. Ltd.				
4,450 % fällig am 17.08.2026 ^		100	11	0,00
4,800 % fällig am 17.05.2028 ^		700	81	0,03
5,950 % fällig am 20.10.2025 ^		900	104	0,03
6,000 % fällig am 16.07.2025 ^		200	23	0,01
CK Hutchison International Ltd.				
4,750 % fällig am 21.04.2028		1.500	1.484	0,46
4,875 % fällig am 21.04.2033		1.700	1.684	0,53
Country Garden Holdings Co. Ltd.				
2,700 % fällig am 12.07.2026		200	61	0,02
3,125 % fällig am 22.10.2025		400	126	0,04
3,875 % fällig am 22.10.2030		1.500	429	0,13
4,200 % fällig am 06.02.2026		800	255	0,08
4,800 % fällig am 06.08.2030		1.500	434	0,14
5,125 % fällig am 14.01.2027		700	222	0,07
5,625 % fällig am 14.01.2030		500	157	0,05
6,150 % fällig am 17.09.2025		300	99	0,03
7,250 % fällig am 08.04.2026		3.200	1.126	0,35
eHi Car Services Ltd.				
7,000 % fällig am 21.09.2026		1.400	843	0,26
7,750 % fällig am 14.11.2024		500	394	0,12
FWD Group Ltd.				
6,375 % fällig am 13.09.2024 (e)	$	200	$ 179	0,06
8,045 % fällig am 15.12.2023 (e)		200	182	0,06
Geely Automobile Holdings Ltd.				
4,000 % fällig am 09.12.2024 (e)		2.000	1.915	0,60
Goodman HK Finance				
3,000 % fällig am 22.07.2030		700	594	0,19
Health & Happiness International Holdings Ltd.				
13,500 % fällig am 26.06.2026		2.800	2.651	0,83
Kaisa Group Holdings Ltd.				
9,375 % fällig am 30.06.2024 ^		800	53	0,02
9,750 % fällig am 28.09.2023 ^		200	13	0,00
10,500 % fällig am 15.01.2025 ^		2.100	140	0,04
11,250 % fällig am 09.04.2022 ^		500	33	0,01
11,950 % fällig am 12.11.2023 ^		1.200	98	0,03
11,950 % fällig am 22.10.2049 ^		300	20	0,01
Longfor Group Holdings Ltd.				
3,950 % fällig am 16.09.2029		400	300	0,09
4,500 % fällig am 16.01.2028		400	326	0,10
Melco Resorts Finance Ltd.				
4,875 % fällig am 06.06.2025		900	858	0,27
5,250 % fällig am 26.04.2026		1.700	1.575	0,49
5,750 % fällig am 21.07.2028		2.900	2.567	0,80
MGM China Holdings Ltd.				
4,750 % fällig am 01.02.2027		1.600	1.458	0,46
5,250 % fällig am 18.06.2025		200	192	0,06
Powerlong Real Estate Holdings Ltd.				
5,950 % fällig am 30.04.2025		400	41	0,01
6,250 % fällig am 10.08.2024		400	40	0,01
Sands China Ltd.				
2,800 % fällig am 08.03.2027		1.500	1.303	0,41
4,875 % fällig am 18.06.2030		400	356	0,11
5,625 % fällig am 08.08.2025		2.100	2.050	0,64
5,900 % fällig am 08.08.2028		1.900	1.813	0,57
Seazen Group Ltd.				
4,450 % fällig am 13.07.2025		600	312	0,10
6,000 % fällig am 12.08.2024		500	357	0,11
Shui On Development Holding Ltd.				
5,500 % fällig am 29.06.2026		700	520	0,16
Sunac China Holdings Ltd.				
5,950 % fällig am 26.04.2024 ^		300	45	0,01
6,500 % fällig am 10.01.2025 ^		200	30	0,01
6,650 % fällig am 03.08.2024 ^		3.000	443	0,14
6,800 % fällig am 20.10.2024 ^		800	123	0,04
7,950 % fällig am 11.10.2023 ^		500	75	0,02
8,350 % fällig am 19.04.2023 ^		800	118	0,04
Sunny Optical Technology Group Co. Ltd.				
5,950 % fällig am 17.07.2026		1.600	1.598	0,50
Tencent Holdings Ltd.				
3,240 % fällig am 03.06.2050		1.100	723	0,23
Times China Holdings Ltd.				
5,550 % fällig am 04.06.2024 ^		1.900	135	0,04
VLL International, Inc.				
5,750 % fällig am 28.11.2024		200	194	0,06
Wynn Macau Ltd.				
4,875 % fällig am 01.10.2024		2.250	2.196	0,69
5,500 % fällig am 15.01.2026		1.500	1.395	0,44
5,500 % fällig am 01.10.2027		400	357	0,11
5,625 % fällig am 26.08.2028		300	262	0,08
Zhongsheng Group Holdings Ltd.				
3,000 % fällig am 13.01.2026		1.650	1.505	0,47
			46.039	14,39
Summe Cayman Inseln			49.967	15,62
CHINA				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
China Huaneng Group Hong Kong Treasury Management Holding Ltd.				
3,080 % fällig am 09.12.2025 (e)		1.000	944	0,29
CNAC HK Finbridge Co. Ltd.				
3,875 % fällig am 19.06.2029		3.000	2.707	0,85
Flourish Century				
6,600 % fällig am 04.02.2022 ^(h)		1.700	189	0,06
Greenland Global Investment Ltd.				
5,875 % fällig am 03.07.2026		2.400	420	0,13
7,250 % fällig am 22.01.2027		1.100	181	0,06
Huaxin Cement International Finance Co. Ltd.				
2,250 % fällig am 19.11.2025	$	900	$ 806	0,25
Midea Investment Development Co. Ltd.				
2,880 % fällig am 24.02.2027		1.500	1.358	0,42
New Metro Global Ltd.				
4,625 % fällig am 15.10.2025		1.140	576	0,18
4,800 % fällig am 15.12.2024		700	479	0,15
SF Holding Investment Ltd.				
2,375 % fällig am 17.11.2026		600	540	0,17
Yango Group Co. Ltd.				
6,900 % fällig am 31.10.2022 ^	CNY	20.000	146	0,05
Yango Justice International Ltd.				
7,875 % fällig am 04.09.2024 ^	$	700	11	0,00
Yunda Holding Investment Ltd.				
2,250 % fällig am 19.08.2025		2.300	2.069	0,65
ZhongAn Online P&C Insurance Co. Ltd.				
3,125 % fällig am 16.07.2025		2.500	2.212	0,69
Summe China			12.638	3,95
FRANKREICH				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
BNP Paribas S.A.				
9,250 % fällig am 17.11.2027 (e)(g)		700	723	0,22
Societe Generale S.A.				
9,375 % fällig am 22.11.2027 (e)(g)		1.000	980	0,31
Summe Frankreich			1.703	0,53
DEUTSCHLAND				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
BMW Finance NV				
3,440 % fällig am 15.06.2024	CNY	7.000	971	0,30
Deutsche Bank AG				
4,500 % fällig am 30.11.2026 (e)(g)	€	200	155	0,05
10,000 % fällig am 01.12.2027 (e)(g)		400	434	0,14
Summe Deutschland			1.560	0,49
HONGKONG				
WANDELANLEIHEN & WECHSEL				
Universe Trek Ltd.				
0,000 % fällig am 15.06.2026 (c)	$	200	194	0,06
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Bank of East Asia Ltd.				
6,750 % fällig am 15.03.2027		1.700	1.681	0,53
China Cinda Finance Ltd.				
4,750 % fällig am 08.02.2028		1.000	960	0,30
Fortune Star BVI Ltd.				
3,950 % fällig am 02.10.2026	€	800	602	0,19
5,000 % fällig am 18.05.2026	$	700	526	0,16
5,050 % fällig am 27.01.2027		700	485	0,15
5,950 % fällig am 19.10.2025		600	481	0,15
6,850 % fällig am 02.07.2024		200	180	0,06
GLP China Holdings Ltd.				
2,950 % fällig am 29.03.2026		900	561	0,18
4,974 % fällig am 26.02.2024		400	356	0,11
Huarong Finance Co. Ltd.				
4,250 % fällig am 07.11.2027		500	417	0,13
4,500 % fällig am 29.05.2029		4.800	3.852	1,20
4,625 % fällig am 03.06.2026		300	267	0,08
4,875 % fällig am 22.11.2026		400	354	0,11
5,000 % fällig am 19.11.2025		500	462	0,14
6,625 % fällig am 24.02.2025		400	376	0,12
Lenovo Group Ltd.				
6,536 % fällig am 27.07.2032		700	707	0,22
Sino-Ocean Land Treasure Ltd.				
2,700 % fällig am 13.01.2025		1.400	444	0,14
3,250 % fällig am 05.05.2026		1.000	309	0,10
4,750 % fällig am 05.08.2029		400	82	0,03
4,750 % fällig am 14.01.2030		1.000	207	0,07
Yanlord Land HK Co. Ltd.				
5,125 % fällig am 20.05.2026		600	494	0,15
			13.803	4,32

Aufstellung des Wertpapierbestands des Asia Strategic Interest Bond Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG		PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
STAATSEMISSIONEN				
Airport Authority Hong Kong				
2,500 % fällig am 12.01.2032	$	3.600	$ 3.065	0,96
4,750 % fällig am 12.01.2028		1.250	1.247	0,39
4,875 % fällig am 12.01.2030		1.300	1.322	0,41
			5.634	1,76
Summe Hongkong			19.631	6,14
INDIEN				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Adani Electricity Mumbai Ltd.				
3,949 % fällig am 12.02.2030		1.200	893	0,28
Adani Green Energy UP Ltd.				
6,250 % fällig am 10.12.2024		1.000	960	0,30
Adani Transmission Step-One Ltd.				
4,000 % fällig am 03.08.2026		800	700	0,22
GMR Hyderabad International Airport Ltd.				
4,250 % fällig am 27.10.2027		2.000	1.773	0,56
Indian Railway Finance Corp. Ltd.				
3,570 % fällig am 21.01.2032		2.100	1.833	0,57
JSW Hydro Energy Ltd.				
4,125 % fällig am 18.05.2031		924	780	0,24
Muthoot Finance Ltd.				
4,400 % fällig am 02.09.2023		791	786	0,25
Network i2i Ltd.				
5,650 % fällig am 15.01.2025 (e)		200	195	0,06
NTPC Ltd.				
4,250 % fällig am 26.02.2026		600	578	0,18
ONGC Videsh Vankorneft Pte. Ltd.				
3,750 % fällig am 27.07.2026		1.000	946	0,30
Reliance Industries Ltd.				
2,875 % fällig am 12.01.2032		700	584	0,18
Shriram Finance Ltd.				
4,150 % fällig am 18.07.2025		958	907	0,28
4,400 % fällig am 13.03.2024		2.480	2.427	0,76
UltraTech Cement Ltd.				
2,800 % fällig am 16.02.2031		2.100	1.727	0,54
Summe Indien			15.089	4,72
INDONESIEN				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Bank Mandiri Persero Tbk PT				
5,500 % fällig am 04.04.2026		1.800	1.800	0,56
Bank Negara Indonesia Persero Tbk PT				
3,750 % fällig am 30.03.2026 (g)		2.220	2.056	0,64
4,300 % fällig am 24.03.2027 (e)(g)		450	373	0,12
Bank Rakyat Indonesia Persero Tbk PT				
4,625 % fällig am 20.07.2023		3.000	2.998	0,94
Bukit Makmur Mandiri Utama PT				
7,750 % fällig am 10.02.2026		2.200	1.881	0,59
Cikarang Listrindo Tbk PT				
4,950 % fällig am 14.09.2026		400	382	0,12
Freeport Indonesia PT				
4,763 % fällig am 14.04.2027		700	679	0,21
5,315 % fällig am 14.04.2032		1.600	1.517	0,47
Indofood CBP Sukses Makmur Tbk PT				
3,541 % fällig am 27.04.2032		700	590	0,19
Indonesia Asahan Aluminium PT				
5,800 % fällig am 15.05.2050		1.200	1.060	0,33
LLPL Capital Pte. Ltd.				
6,875 % fällig am 04.02.2039		993	892	0,28
Medco Oak Tree Pte. Ltd.				
7,375 % fällig am 14.05.2026		1.800	1.772	0,55
Minejesa Capital BV				
4,625 % fällig am 10.08.2030		400	360	0,11
Pakuwon Jati Tbk PT				
4,875 % fällig am 29.04.2028		200	180	0,06
Pelabuhan Indonesia Persero PT				
4,875 % fällig am 01.10.2024		700	694	0,22
Pertamina Persero PT				
1,400 % fällig am 09.02.2026		700	633	0,20
Perusahaan Perseroan Persero PT Perusahaan Listrik Negara				
3,375 % fällig am 05.02.2030		2.300	2.020	0,63
Saka Energi Indonesia PT				
4,450 % fällig am 05.05.2024	$	700	$ 683	0,21
			20.570	6,43
STAATSEMISSIONEN				
Indonesia Government International Bond				
4,650 % fällig am 20.09.2032		2.900	2.846	0,89
5,250 % fällig am 17.01.2042		900	900	0,28
			3.746	1,17
Summe Indonesien			24.316	7,60
IRLAND				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
SMBC Aviation Capital Finance DAC				
5,450 % fällig am 03.05.2028		3.200	3.159	0,99
JAPAN				
WANDELANLEIHEN & WECHSEL				
ANA Holdings, Inc.				
0,000 % fällig am 10.12.2031 (c)	¥	90.000	768	0,24
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Asahi Mutual Life Insurance Co.				
6,900 % fällig am 26.01.2028 (e)	$	600	606	0,19
Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc.				
5,063 % fällig am 12.09.2025		2.900	2.866	0,90
Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd.				
4,800 % fällig am 15.09.2025		2.900	2.845	0,89
			6.317	1,98
Summe Japan			7.085	2,22
JERSEY, KANALINSELN				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
West China Cement Ltd.				
4,950 % fällig am 08.07.2026		1.700	1.305	0,41
LUXEMBURG				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Guara Norte SARL				
5,198 % fällig am 15.06.2034		796	698	0,22
MALAYSIA				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Genm Capital Labuan Ltd.				
3,882 % fällig am 19.04.2031		500	405	0,13
Khazanah Capital Ltd.				
4,876 % fällig am 01.06.2033		300	297	0,09
Khazanah Global Sukuk Bhd.				
4,687 % fällig am 01.06.2028		1.200	1.185	0,37
Misc Capital Two Labuan Ltd.				
3,625 % fällig am 06.04.2025		3.900	3.751	1,17
Petronas Capital Ltd.				
2,480 % fällig am 28.01.2032		600	502	0,16
3,404 % fällig am 28.04.2061		550	393	0,12
Petronas Energy Canada Ltd.				
2,112 % fällig am 23.03.2028		700	622	0,19
			7.155	2,23
STAATSEMISSIONEN				
Export-Import Bank of Malaysia Bhd.				
1,831 % fällig am 26.11.2026		1.000	888	0,28
Summe Malaysia			8.043	2,51
MAURITIUS				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
CA Magnum Holdings				
5,375 % fällig am 31.10.2026		2.500	2.245	0,70
Greenko Dutch BV				
3,850 % fällig am 29.03.2026		2.632	2.369	0,74
India Cleantech Energy				
4,700 % fällig am 10.08.2026		275	241	0,08
India Green Energy Holdings				
5,375 % fällig am 29.04.2024		3.400	3.325	1,04
India Toll Roads				
5,500 % fällig am 19.08.2024	$	2.000	$ 1.932	0,60
Summe Mauritius			10.112	3,16
MEXIKO				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Banco Mercantil del Norte S.A.				
5,875 % fällig am 24.01.2027 (e)(g)		850	726	0,23
MONGOLEI				
STAATSEMISSIONEN				
Mongolia Government International Bond				
4,450 % fällig am 07.07.2031		1.600	1.244	0,39
8,650 % fällig am 19.01.2028		1.530	1.543	0,48
Summe Mongolei			2.787	0,87
NIEDERLANDE				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Mong Duong Finance Holdings BV				
5,125 % fällig am 07.05.2029		2.000	1.765	0,55
Prosus NV				
4,193 % fällig am 19.01.2032		1.200	1.011	0,32
4,987 % fällig am 19.01.2052		900	650	0,20
Summe Niederlande			3.426	1,07
PAKISTAN				
STAATSEMISSIONEN				
Pakistan Government International Bond				
6,000 % fällig am 08.04.2026		2.950	1.445	0,45
6,875 % fällig am 05.12.2027		4.200	2.016	0,63
Summe Pakistan			3.461	1,08
PHILIPPINEN				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Globe Telecom, Inc.				
3,000 % fällig am 23.07.2035		200	151	0,05
4,200 % fällig am 02.08.2026 (e)		900	838	0,26
SMC Global Power Holdings Corp.				
5,450 % fällig am 09.12.2026 (e)		300	218	0,07
6,500 % fällig am 25.04.2024 (e)		800	716	0,22
7,000 % fällig am 21.10.2025 (e)		200	168	0,05
			2.091	0,65
STAATSEMISSIONEN				
Philippines Government International Bond				
1,750 % fällig am 28.04.2041	€	1.400	996	0,31
3,200 % fällig am 06.07.2046	$	900	666	0,21
5,000 % fällig am 17.07.2033		600	608	0,19
5,000 % fällig am 13.01.2037		200	200	0,06
5,609 % fällig am 13.04.2033		800	847	0,27
			3.317	1,04
Summe Philippinen			5.408	1,69
SINGAPUR				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
BOC Aviation Ltd.				
3,500 % fällig am 10.10.2024		1.500	1.451	0,45
Clean Renewable Power Mauritius Pte. Ltd.				
4,250 % fällig am 25.03.2027		744	654	0,21
Indika Energy Capital Pte. Ltd.				
8,250 % fällig am 22.10.2025		1.150	1.145	0,36
Medco Bell Pte. Ltd.				
6,375 % fällig am 30.01.2027		778	729	0,23
Oversea-Chinese Banking Corp. Ltd.				
4,602 % fällig am 15.06.2032 (g)		2.700	2.618	0,82
TML Holdings Pte. Ltd.				
5,500 % fällig am 03.06.2024		2.100	2.077	0,65
United Overseas Bank Ltd.				
1,750 % fällig am 16.03.2031 (g)		800	712	0,22
Summe Singapur			9.386	2,94

BESCHREIBUNG		PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
SÜDKOREA				
WANDELANLEIHEN & WECHSEL				
POSCO Holdings, Inc.				
0,000 % fällig am 01.09.2026 (c)	€	800	$ 896	0,28
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Hana Bank				
3,250 % fällig am 30.03.2027	$	2.300	2.155	0,67
KB Capital Co. Ltd.				
1,500 % fällig am 28.10.2025		700	629	0,20
Kodit Global Co. Ltd.				
4,954 % fällig am 25.05.2026		1.500	1.477	0,46
Kookmin Bank				
2,500 % fällig am 04.11.2030 (g)		1.400	1.137	0,36
POSCO				
5,750 % fällig am 17.01.2028		3.700	3.755	1,17
Shinhan Bank Co. Ltd.				
4,000 % fällig am 23.04.2029 (g)		200	182	0,06
Shinhan Card Co. Ltd.				
2,500 % fällig am 27.01.2027		3.400	3.034	0,95
SK Broadband Co. Ltd.				
4,875 % fällig am 28.06.2028		1.500	1.479	0,46
SK Hynix, Inc.				
1,500 % fällig am 19.01.2026		200	177	0,05
2,375 % fällig am 19.01.2031		2.720	2.100	0,66
SK on Co. Ltd.				
5,375 % fällig am 11.05.2026		3.200	3.175	0,99
Tongyang Life Insurance Co. Ltd.				
5,250 % fällig am 22.09.2025 (e)		1.700	1.504	0,47
Woori Bank				
4,875 % fällig am 26.01.2028		1.800	1.783	0,56
			22.587	7,06
STAATSEMISSIONEN				
Export-Import Bank of Korea				
5,125 % fällig am 11.01.2033		300	308	0,10
Korea Electric Power Corp.				
5,375 % fällig am 06.04.2026		5.700	5.683	1,78
Korea Housing Finance Corp.				
4,625 % fällig am 24.02.2028		6.800	6.703	2,09
Korea Mine Rehabilitation & Mineral Resources Corp.				
5,375 % fällig am 11.05.2028		2.250	2.217	0,69
Korea National Oil Corp.				
4,750 % fällig am 03.04.2026		1.300	1.276	0,40
4,875 % fällig am 03.04.2028		3.100	3.071	0,96
			19.258	6,02
Summe Südkorea			42.741	13,36
SRI LANKA				
STAATSEMISSIONEN				
Sri Lanka Government International Bond				
5,750 % fällig am 18.04.2023 ^		500	228	0,07
6,200 % fällig am 11.05.2027 ^		1.400	645	0,20
6,350 % fällig am 28.06.2024 ^		500	230	0,07
6,825 % fällig am 18.07.2026 ^		500	237	0,07
6,850 % fällig am 14.03.2024 ^		600	276	0,09
6,850 % fällig am 03.11.2025 ^		1.976	942	0,30
7,550 % fällig am 28.03.2030 ^		1.100	506	0,16
Summe Sri Lanka			3.064	0,96

BESCHREIBUNG		PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
THAILAND				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Bangkok Bank PCL				
4,300 % fällig am 15.06.2027	$	1.800	$ 1.750	0,55
Kasikornbank PCL				
5,275 % fällig am 14.10.2025 (e)(g)		1.100	1.040	0,33
5,458 % fällig am 07.03.2028		2.700	2.703	0,84
Summe Thailand			5.493	1,72
GROSSBRITANNIEN				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Diamond Ltd.				
7,950 % fällig am 28.07.2026		600	591	0,18
HSBC Holdings PLC				
8,000 % fällig am 07.03.2028 (e)(g)		600	597	0,19
Jaguar Land Rover Automotive PLC				
4,500 % fällig am 15.07.2028	€	900	860	0,27
Prudential Funding Asia PLC				
2,950 % fällig am 03.11.2033	$	700	592	0,18
Standard Chartered PLC				
0,991 % fällig am 12.01.2025		1.200	1.164	0,36
1,822 % fällig am 23.11.2025		1.400	1.310	0,41
3,603 % fällig am 12.01.2033 (h)		500	401	0,13
6,000 % fällig am 26.07.2025 (e)(g)		1.200	1.143	0,36
6,170 % fällig am 09.01.2027		1.500	1.499	0,47
6,187 % fällig am 06.07.2027 (a)		500	500	0,16
6,301 % fällig am 09.01.2029		2.300	2.314	0,72
7,750 % fällig am 15.08.2027 (e)(g)		2.100	2.085	0,65
Vedanta Resources Finance PLC				
8,950 % fällig am 11.03.2025		1.350	1.021	0,32
Summe Großbritannien			14.077	4,40
USA				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Hyundai Capital America				
2,750 % fällig am 27.09.2026		700	637	0,20
Stillwater Mining Co.				
4,000 % fällig am 16.11.2026		800	715	0,22
			1.352	0,42
US-SCHATZOBLIGATIONEN				
U.S. Treasury Bonds				
1,875 % fällig am 15.11.2051		600	396	0,12
2,250 % fällig am 15.08.2049		20	15	0,01
U.S. Treasury Inflation Protected Securities (d)				
0,125 % fällig am 15.01.2032		4.267	3.759	1,18
U.S. Treasury Notes				
3,250 % fällig am 31.08.2024		6.100	5.954	1,86
			10.124	3,17
Summe USA			11.476	3,59
VIETNAM				
STAATSEMISSIONEN				
Vietnam Debt & Asset Trading Corp.				
1,000 % fällig am 10.10.2025		1.600	1.354	0,42
Vietnam Government International Bond				
5,500 % fällig am 12.03.2028		1.950	1.882	0,59
Summe Vietnam			3.236	1,01

BESCHREIBUNG		PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
0,000 % fällig am 26.08.2023 (c)	$	1.000	$ 990	0,31
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Celestial Miles Ltd.				
5,750 % fällig am 31.01.2024 (e)		1.600	1.580	0,49
Champion Path Holdings Ltd.				
4,500 % fällig am 27.01.2026		900	796	0,25
Easy Tactic Ltd. (6,500 % bar oder 7,500 % PIK)				
7,500 % fällig am 11.07.2027 (b)		700	60	0,02
7,500 % fällig am 11.07.2028 (b)		3.400	255	0,08
NWD Finance BVI Ltd.				
4,125 % fällig am 10.03.2028 (e)		3.550	2.412	0,75
4,800 % fällig am 09.09.2023 (e)		400	236	0,07
5,250 % fällig am 22.03.2026 (e)		1.600	1.410	0,44
Peak RE BVI Holding Ltd.				
5,350 % fällig am 28.10.2025 (e)		1.300	1.079	0,34
RKPF Overseas Ltd.				
5,125 % fällig am 26.07.2026		2.600	1.192	0,37
5,900 % fällig am 05.03.2025		305	194	0,06
Studio City Finance Ltd.				
5,000 % fällig am 15.01.2029		1.100	816	0,26
6,000 % fällig am 15.07.2025		1.100	1.022	0,32
TSMC Global Ltd.				
1,750 % fällig am 23.04.2028		1.800	1.551	0,49
Wanda Properties Global Co. Ltd.				
11,000 % fällig am 20.01.2025		300	134	0,04
11,000 % fällig am 13.02.2026		200	85	0,03
Wheelock MTN BVI Ltd.				
2,375 % fällig am 25.01.2026		1.500	1.381	0,43
			14.203	4,44
Summe Jungferninseln (Britisch)			15.193	4,75
Summe Übertragbare Wertpapiere			**$ 281.696**	**88,08**

	AKTIEN		
INVESTMENTFONDS			
ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN			
PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (f)	1.989.038	19.807	6,19
PIMCO Specialty Funds Ireland p.l.c. - PIMCO China Bond Fund (f)	1.880	25	0,01
		19.832	6,20
BÖRSENGEHANDELTE FONDS			
PIMCO ETFs plc - PIMCO US Dollar Short Maturity UCITS ETF (f)	10.100	1.003	0,31
Summe Investmentfonds		**$ 20.835**	**6,51**

PENSIONSGESCHÄFTE

Kontrahent	Kredit-zins	Abrechnungs-datum	Fälligkeits-datum	Kapital-betrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensions-geschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensions-geschäft[1]	% des Nettovermögens
SSB	2,400 %	30.06.2023	03.07.2023	$ 347	U.S. Treasury Notes 1,875 % fällig am 30.06.2026	$ (354)	$ 347	$ 347	0,11
Summe Pensionsgeschäfte						**$ (354)**	**$ 347**	**$ 347**	**0,11**

[1] Umfasst aufgelaufene Zinsen.

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

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

FUTURES

Beschreibung	Art	Ablauf-monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Euro-Bobl September Futures	Short	09.2023	6	$ 10	0,00
Euro-Bund 10-Year Bond September Futures	Short	09.2023	3	4	0,00
Euro-Buxl 30-Year Bond September Futures	Short	09.2023	4	(9)	0,00
U.S. Treasury 2-Year Note September Futures	Long	09.2023	32	(94)	(0,03)
U.S. Treasury 5-Year Note September Futures	Short	09.2023	33	68	0,02
U.S. Treasury 10-Year Note September Futures	Long	09.2023	175	(330)	(0,10)
U.S. Treasury 10-Year Ultra September Futures	Short	09.2023	11	15	0,00
U.S. Treasury 30-Year Bond September Futures	Long	09.2023	40	(2)	0,00
U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond September Futures	Long	09.2023	67	52	0,02
				$ (286)	(0,09)
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate				**$ (286)**	**(0,09)**

ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)

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

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMMISSIONEN - SCHUTZVERKAUF[1]

Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag[2]	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Atlantia SpA	1,000 %	20.06.2025	€ 100	$ 8	0,00
Jaguar Land Rover Automotive PLC	5,000	20.06.2026	400	(22)	(0,01)
Jaguar Land Rover Automotive PLC	5,000	20.06.2028	400	19	0,01
				$ 5	0,00

ZINSSWAPS

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Erhalt[3]	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,850 %	20.09.2033	¥ 450.000	$ (26)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	0,500	15.06.2024	$ 10.900	(35)	(0,01)
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,750	15.06.2029	14.400	332	0,10
Zahlung	3-Month KRW-KORIBOR	3,250	15.03.2033	KRW 5.041.456	(39)	(0,01)
Zahlung	3-Month KRW-KORIBOR	3,500	15.03.2028	4.761.600	27	0,01
Erhalt	6-Month AUD-BBR-BBSW	0,500	16.12.2025	AUD 800	59	0,02
					$ 318	0,10
Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate					**$ 323**	**0,10**

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

(2) Der maximal mögliche Betrag, den der Fonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

(3) Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft.

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

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

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMMISSIONEN - SCHUTZKAUF[1]

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu bezahlender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag[3]	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Markt-wert	% des Nettovermögens
BOA	Saudi Arabia Government International Bond	(1,000) %	20.06.2028	$ 5.200	$ (75)	$ (27)	$ (102)	(0,03)

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMMISSIONEN - SCHUTZVERKAUF[2]

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag[3]	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Markt-wert	% des Nettovermögens
BPS	Longfor Group Holdings Ltd,	1,000 %	20.06.2026	$ 600	$ (10)	$ (61)	$ (71)	(0,03)
BRC	BOC Aviation Ltd,	1,000	20.06.2026	2.000	(7)	11	4	0,00
	Philippines Government International Bond	1,000	20.06.2028	2.400	11	9	20	0,01
CBK	Indonesia Government International Bond	1,000	20.06.2028	9.600	51	12	63	0,02
	Vietnam Government International Bond	1,000	20.12.2027	1.400	(40)	37	(3)	0,00
					$ 5	$ 8	$ 13	0,00

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

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

(3) Der maximal mögliche Betrag, den der Fonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

ZINSSWAPS

Kontrahent	Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Markt-wert	% des Nettovermögens
GLM	Erhalt	3-Month MYR-KLIBOR	3,545 %	05.05.2028	MYR 15.644	$ 0	$ 18	$ 18	0,01
GST	Erhalt	3-Month MYR-KLIBOR	3,500	15.03.2028	19.310	6	23	29	0,01
						$ 6	$ 41	$ 47	0,02

DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung		Zu erhaltende Währung		Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	08.2023	AUD	1.425	$	963	$ 14	$ 0	$ 14	0,01
	08.2023	CNY	1.082		158	8	0	8	0,00
	08.2023	¥	451.300		3.160	17	0	17	0,01
	09.2023	IDR	358.262		24	0	0	0	0,00
	09.2023	TWD	15.282		503	12	0	12	0,01
	09.2023	$	98	HKD	762	0	0	0	0,00
	09.2023		1.761	INR	145.646	9	0	9	0,00
BPS	07.2023		4.019	€	3.668	0	(17)	(17)	(0,01)
	07.2023		1.722	MYR	7.906	0	(25)	(25)	(0,01)
	08.2023	CNY	1.273	$	186	10	0	10	0,00
	08.2023	€	3.668		4.025	17	0	17	0,01
	08.2023	TWD	7.649		251	5	0	5	0,00
	08.2023	$	774	CNH	5.348	0	(36)	(36)	(0,01)
	09.2023	THB	371	$	11	0	0	0	0,00
BRC	08.2023	$	114	¥	15.085	0	(9)	(9)	0,00
	09.2023	PHP	93.068	$	1.661	0	(19)	(19)	(0,01)
CBK	07.2023		170.959		3.134	43	0	43	0,01
	08.2023	TWD	7.964		261	5	0	5	0,00
	09.2023	$	1.645	INR	135.260	0	(1)	(1)	0,00
DUB	08.2023	CNH	12.708	$	1.805	54	0	54	0,02
GLM	09.2023	$	3.336	THB	115.103	0	(66)	(66)	(0,02)
JPM	07.2023	€	15	$	16	0	0	0	0,00
	07.2023	PHP	11.188		205	2	0	2	0,00
	08.2023	CNH	9.498		1.355	45	0	45	0,02
	08.2023	CNY	1.343		196	11	0	11	0,00
	08.2023	$	621	CNH	4.293	0	(29)	(29)	(0,01)
	09.2023	IDR	149.873	$	10	0	0	0	0,00
	09.2023	THB	806		24	1	0	1	0,00
	09.2023	$	2	IDR	26.413	0	0	0	0,00
MYI	07.2023	HKD	20	$	3	0	0	0	0,00
	07.2023	IDR	94.440		6	0	0	0	0,00
	07.2023	$	13	€	12	0	0	0	0,00
	07.2023		1	£	1	0	0	0	0,00
	07.2023		6	IDR	94.440	0	0	0	0,00
	08.2023	CNH	2.673	$	382	13	0	13	0,01
	08.2023	TWD	8.456		279	7	0	7	0,00
	08.2023	$	1.625	¥	216.013	0	(122)	(122)	(0,04)
	09.2023	IDR	94.522	$	6	0	0	0	0,00
	09.2023	$	11	IDR	168.118	0	0	0	0,00
SCX	07.2023		1.727	MYR	7.936	0	(23)	(23)	(0,01)
	08.2023	CNH	15.880	$	2.313	124	0	124	0,04
	08.2023	CNY	3.566		522	29	0	29	0,01
	08.2023	TWD	177		6	0	0	0	0,00
	08.2023	$	296	CNH	2.035	0	(15)	(15)	0,00
	08.2023		1.732	TWD	52.659	0	(41)	(41)	(0,01)
	09.2023	THB	834	$	24	0	0	0	0,00
	09.2023	TWD	12.770		419	8	0	8	0,00
	09.2023	$	1.773	IDR	26.360.654	0	(22)	(22)	(0,01)
SOG	07.2023	€	3.668	$	3.946	0	(56)	(56)	(0,02)
TOR	08.2023	$	750	¥	99.487	0	(58)	(58)	(0,02)
UAG	08.2023		228	CNH	1.580	0	(10)	(10)	0,00
	09.2023	SGD	4.587	$	3.432	33	0	33	0,01
	09.2023	$	1.667	INR	137.786	8	0	8	0,00
						$ 475	$ (549)	$ (74)	(0,02)

ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 30. Juni 2023 standen für die Institutional EUR (Hedged) thesaurierend, Institutional EUR (Hedged) ausschüttend, Investor EUR (Hedged) thesaurierend und Class E EUR (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
AZD	07.2023	$ 49	€ 45	$ 0	$ 0	$ 0	0,00
BOA	07.2023	€ 55	$ 58	0	(1)	(1)	0,00
	07.2023	$ 36.935	€ 34.365	558	0	558	0,18
CBK	07.2023	€ 37.057	$ 40.259	1	(170)	(169)	(0,05)
	07.2023	$ 126	€ 117	2	0	2	0,00
	08.2023	38.011	34.913	131	0	131	0,04
GLM	07.2023	2.093	1.959	45	0	45	0,01
MBC	07.2023	€ 652	$ 715	3	0	3	0,00
	07.2023	$ 37.987	€ 35.529	775	0	775	0,24
SCX	07.2023	37.030	34.602	721	0	721	0,23
UAG	07.2023	€ 92	$ 100	0	(1)	(1)	0,00
				$ 2.236	$ (172)	$ 2.064	0,65

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklasse Institutional GBP (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
CBK	07.2023	$ 29	£ 23	$ 0	$ 0	$ 0	0,00
MBC	07.2023	117	94	3	0	3	0,00
MYI	07.2023	120	96	3	0	3	0,00
SCX	07.2023	31	25	1	0	1	0,00
UAG	07.2023	94	75	2	0	2	0,00
				$ 9	$ 0	$ 9	0,00

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklassen Institutional SGD (Hedged) ausschüttend und Class E SGD (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
GLM	07.2023	$ 1.325	SGD 1.781	$ 0	$ (9)	$ (9)	(0,01)
MBC	07.2023	2.038	2.754	0	(3)	(3)	0,00
	08.2023	35	47	0	0	0	0,00
MYI	07.2023	SGD 3.488	$ 2.581	4	0	4	0,00
	08.2023	$ 2.547	SGD 3.439	0	(4)	(4)	0,00
SCX	07.2023	2.149	2.909	0	0	0	0,00
UAG	07.2023	2.396	3.239	0	(3)	(3)	0,00
				$ 4	$ (19)	$ (15)	(0,01)

Summe Freiverkehrsfinanzderivate	**$ 1.942**	**0,61**
Summe Anlagen	**$ 304.857**	**95,32**
Sonstige Aktiva und Passiva	**$ 14.962**	**4,68**
Nettovermögen	**$ 319.819**	**100,00**

ERLÄUTERUNGEN ZUR AUFSTELLUNG DES WERTPAPIERBESTANDS (Angaben in Tausend*):

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

^ **Das Wertpapier ist in Verzug.**

(a) **Wertpapier per Emissionstermin.**

(b) **Wertpapier mit Sachwertausschüttung.**

(c) **Nullkuponwertpapier.**

(d) **Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.**

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

(f) **Mit dem Fonds verbunden.**

(g) **Bedingt wandelbares Wertpapier.**

(h) **Eingeschränkte Wertpapiere (31. Dezember 2022: 0,06 %):**

Emittentenbeschreibung	Kupon	Fälligkeits-datum	Kauf-datum	Kosten	Markt-wert	% des Nettovermögens
Flourish Century	6,600 %	04.02.2022	25.08.2021 - 27.08.2021	$ 1.676	$ 189	0,06
Standard Chartered PLC	3,603	12.01.2033	06.02.2023	432	401	0,13
				$ 2.108	$ 590	0,19

Barmittel in Höhe von 2.463 USD (31. Dezember 2022: 1.987 USD) wurden zum 30. Juni 2023 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Wertpapier mit einem gesamten beizulegenden Zeitwert von null USD (31. Dezember 2022: null USD) und Barmittel in Höhe von null USD (31. Dezember 2022: 30 USD) wurden zum 30. Juni 2023 gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. als Sicherheit für Finanzderivate verpfändet.

Beizulegender Zeitwert[1]

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 30. Juni 2023 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie[2]	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	$ 0	$ 279.938	$ 1.758	$ 281.696
Investmentfonds	20.835	0	0	20.835
Pensionsgeschäfte	0	347	0	347
Finanzderivate[3]	5	1.974	0	1.979
Summen	**$ 20.840**	**$ 282.259**	**$ 1.758**	**$ 304.857**

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

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

(1) Siehe Erläuterung 3 in den Erläuterungen zum Abschluss für weitere Informationen.

(2) Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung des Wertpapierbestands.

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

Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC-Finanzderivate und -Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2023 und 31. Dezember 2022:

	Zum 30. Jun. 2023			Zum 31. Dez. 2022		
Kontrahent	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-engagement[1]	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Nettoengagement[1]
BOA	$ 515	$ (590)	$ (75)	$ (103)	$ 0	$ (103)
BPS	(117)	0	(117)	(80)	0	(80)
BRC	(4)	0	(4)	(20)	30	10
CBK	71	0	71	917	(820)	97
DUB	54	0	54	77	0	77
GLM	(12)	0	(12)	61	(250)	(189)
GST	29	0	29	k. A.	k. A.	k. A.
JPM	30	0	30	34	0	34
MBC	778	(740)	38	661	(670)	(9)
MYI	(99)	0	(99)	10	(129)	(119)
SCX	782	(690)	92	894	(680)	214
SOG	(56)	0	(56)	k. A.	k. A.	k. A.
TOR	(58)	0	(58)	k. A.	k. A.	k. A.
UAG	29	0	29	2	0	2

(1) Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären.

Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung des Wertpapierbestands zum 30. Juni 2023:

	30. Jun. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	74,58	75,24
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	13,50	12,97
Investmentfonds	6,51	9,47
Pensionsgeschäfte	0,11	0,26
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	(0,09)	(0,05)
Zentral abgerechnete Finanzderivate	0,10	0,11
Freiverkehrsfinanzderivate	0,61	0,78

Das Anlageportfolio des Fonds konzentriert sich zum 30. Juni 2023 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	30. Jun. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
Australien	1,75	2,17
Brasilien	0,10	0,10
Cayman-Inseln	15,62	17,23
China	3,95	4,71

Anlagen zum Marktwert	30. Jun. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
Frankreich	0,53	0,56
Deutschland	0,49	0,68
Hongkong	6,14	5,57
Indien	4,72	7,64
Indonesien	7,60	9,42
Irland	0,99	k. A.
Israel	k. A.	0,15
Japan	2,22	2,19
Jersey, Kanalinseln	0,41	0,38
Luxemburg	0,22	0,22
Malaysia	2,51	2,11
Mauritius	3,16	4,60
Mexiko	0,23	0,24
Mongolei	0,87	0,53
Niederlande	1,07	1,40
Pakistan	1,08	0,87
Philippinen	1,69	1,62
Singapur	2,94	3,04
Südkorea	13,36	7,62
Sri Lanka	0,96	0,70
Thailand	1,72	2,83
Großbritannien	4,40	1,74
USA	3,59	4,01
Vietnam	1,01	0,00
Jungferninseln (Britisch)	4,75	5,88
Investmentfonds	6,51	9,47
Pensionsgeschäfte	0,11	0,26
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	(0,09)	(0,05)
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	0,00	(0,02)
Zinsswaps	0,10	0,13
Freiverkehrsfinanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen - Schutzkauf	(0,03)	(0,04)
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	0,00	(0,04)
Zinsswaps	0,02	k. A.
Devisenterminkontrakte	(0,02)	0,03
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	0,64	0,83
Sonstige Aktiva und Passiva	4,68	1,22
Nettovermögen	100,00	100,00

ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE

BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
ÖSTERREICH			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Erste Group Bank AG			
4,250 % fällig am 15.10.2027 (d)(f)	€ 85.400	$ 71.062	1,30
6,500 % fällig am 15.04.2024 (d)(f)	10.200	10.791	0,20
Summe Österreich		81.853	1,50
BELGIEN			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
KBC Group NV			
4,250 % fällig am 24.10.2025 (d)(f)	66.000	62.264	1,14
4,750 % fällig am 05.03.2024 (d)(f)	14.600	15.381	0,28
Summe Belgien		77.645	1,42
KANADA			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Bank of Nova Scotia			
3,625 % fällig am 27.10.2081 (f)(g)(h)	$ 19.200	13.587	0,25
4,900 % fällig am 04.06.2025 (d)(f)(h)	27.300	25.841	0,48
Scotiabank Capital Trust			
5,650 % fällig am 31.12.2056	CAD 18.216	14.246	0,26
Toronto-Dominion Bank			
8,125 % fällig am 31.10.2082 (f)(h)	$ 13.000	13.239	0,24
Summe Kanada		66.913	1,23
DÄNEMARK			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Nykredit Realkredit A/S			
4,125 % fällig am 15.04.2026 (d)(f)	€ 25.600	25.380	0,47
FINNLAND			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Nordea Bank Abp			
3,750 % fällig am 01.03.2029 (d)(f)	$ 58.500	43.430	0,80
FRANKREICH			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Altice France S.A.			
4,250 % fällig am 15.10.2029 (h)	€ 8.800	6.933	0,13
5,500 % fällig am 15.10.2029	$ 17.900	12.819	0,24
BNP Paribas S.A.			
2,871 % fällig am 19.04.2032	2.100	1.722	0,03
3,132 % fällig am 20.01.2033 (h)	16.600	13.634	0,25
3,132 % fällig am 20.01.2033	6.800	5.585	0,10
4,500 % fällig am 25.02.2030 (d)(f)	20.000	14.232	0,26
4,625 % fällig am 12.01.2027 (d)(f)	34.400	27.241	0,50
4,625 % fällig am 25.02.2031 (d)(f)	13.400	9.598	0,18
6,875 % fällig am 06.12.2029 (d)(f)	€ 28.400	29.781	0,55
7,000 % fällig am 16.08.2028 (d)(f)	$ 65.800	59.067	1,08
7,375 % fällig am 11.06.2030 (d)(f)	€ 21.800	23.116	0,42
7,750 % fällig am 16.08.2029 (d)(f)	$ 74.965	72.746	1,33
9,250 % fällig am 17.11.2027 (d)(f)	37.200	38.432	0,70
BPCE S.A.			
1,500 % fällig am 13.01.2042 (f)	€ 8.600	7.912	0,15
2,125 % fällig am 13.10.2046 (f)	36.000	28.133	0,52
Credit Agricole S.A.			
7,250 % fällig am 23.09.2028 (d)(f)	117.500	127.748	2,34
7,875 % fällig am 23.01.2024 (d)(f)	$ 17.200	$ 17.056	0,31
Electricite de France S.A.			
2,875 % fällig am 15.12.2026 (d)	€ 200	186	0,00
9,125 % fällig am 15.03.2033 (d)	$ 23.800	24.466	0,45
Societe Generale S.A.			
3,337 % fällig am 21.01.2033	30.100	24.128	0,44
6,221 % fällig am 15.06.2033	20.300	18.915	0,35
6,446 % fällig am 10.01.2029	400	401	0,01
6,691 % fällig am 10.01.2034	36.200	36.880	0,68
7,875 % fällig am 18.12.2023 (d)(f)	26.800	26.275	0,48
8,000 % fällig am 29.09.2025 (d)(f)	49.150	46.169	0,85
Summe Frankreich		673.175	12,35
DEUTSCHLAND			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Commerzbank AG			
5,125 % fällig am 18.01.2030	€ 1.900	2.071	0,04
6,500 % fällig am 09.10.2029 (d)(f)	31.800	30.297	0,55
6,500 % fällig am 06.12.2032	17.900	19.410	0,36
Deutsche Bank AG			
3,729 % fällig am 14.01.2032 (g)	$ 13.475	10.198	0,19
7,079 % fällig am 10.02.2034	23.185	21.456	0,39
10,000 % fällig am 01.12.2027 (d)(f)	€ 35.800	38.814	0,71
Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG in Muenchen			
5,875 % fällig am 23.05.2042	$ 16.800	16.895	0,31
Summe Deutschland		139.141	2,55
HONGKONG			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Hongkong & Shanghai Banking Corp. Ltd.			
5,460 % fällig am 31.07.2023 (d)(h)	10.165	10.141	0,19
IRLAND			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
AIB Group PLC			
5,250 % fällig am 09.10.2024 (d)(f)	€ 19.260	19.684	0,36
6,250 % fällig am 23.06.2025 (d)(f)	39.950	41.268	0,76
Alfa Bank AO Via Alfa Bond Issuance PLC			
5,950 % fällig am 15.04.2030 ^(f)	$ 16.800	1.008	0,02
Bank of Ireland Group PLC			
6,000 % fällig am 01.09.2025 (d)(f)	€ 6.391	6.616	0,12
7,500 % fällig am 19.05.2025 (d)(f)	82.200	88.128	1,61
Permanent TSB Group Holdings PLC			
13,250 % fällig am 26.10.2027 (d)(f)	22.700	27.662	0,51
Summe Irland		184.366	3,38
ITALIEN			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Banca Monte dei Paschi di Siena SpA			
7,677 % fällig am 18.01.2028	7.208	6.626	0,12
8,000 % fällig am 22.01.2030	8.500	8.339	0,15
8,500 % fällig am 10.09.2030	13.950	13.775	0,25
10,500 % fällig am 23.07.2029	12.250	13.292	0,24
Intesa Sanpaolo SpA			
4,000 % fällig am 23.09.2029 (h)	$ 35.468	30.844	0,57
4,198 % fällig am 01.06.2032	27.230	20.314	0,37
4,950 % fällig am 01.06.2042	8.000	5.278	0,10
5,875 % fällig am 01.09.2031 (d)(f)	€ 23.800	20.725	0,38
6,625 % fällig am 20.06.2033	$ 1.600	1.596	0,03
7,700 % fällig am 17.09.2025 (d)(f)	1.500	1.412	0,03
7,750 % fällig am 11.01.2027 (d)(f)	€ 40.700	43.005	0,79
7,778 % fällig am 20.06.2054	$ 48.400	48.282	0,88
8,248 % fällig am 21.11.2033 (h)	50.200	52.762	0,97
UniCredit SpA			
2,569 % fällig am 22.09.2026 (h)	7.850	7.090	0,13
3,127 % fällig am 03.06.2032	22.600	17.843	0,33
5,459 % fällig am 30.06.2035	17.929	15.230	0,28
7,296 % fällig am 02.04.2034	3.630	3.423	0,06
7,500 % fällig am 03.06.2026 (d)(f)	€ 53.585	57.555	1,06
7,830 % fällig am 04.12.2023	$ 20.200	20.321	0,37
Summe Italien		387.712	7,11
JERSEY, KANALINSELN			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
HSBC Bank Capital Funding Sterling LP			
5,844 % fällig am 05.11.2031 (d)	£ 66.532	85.008	1,56
HSBC Capital Funding Dollar LP			
10,176 % fällig am 30.06.2030 (d)	$ 3.817	$ 4.730	0,09
Summe Jersey, Kanalinseln		89.738	1,65
LUXEMBURG			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
CPI Property Group S.A.			
4,875 % fällig am 16.07.2025 (d)	€ 2.000	790	0,02
4,875 % fällig am 18.08.2026 (d)	14.200	6.218	0,11
Summe Luxemburg		7.008	0,13
NIEDERLANDE			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
ABN AMRO Bank NV			
4,750 % fällig am 22.09.2027 (d)(f)	37.100	34.273	0,63
ASR Nederland NV			
4,625 % fällig am 19.10.2027 (d)(f)	42.750	38.723	0,71
7,000 % fällig am 07.12.2043	10.300	11.717	0,21
Athora Netherlands NV			
7,000 % fällig am 19.06.2025 (d)(f)	31.265	32.280	0,59
Cooperatieve Rabobank UA			
3,100 % fällig am 29.06.2028 (d)(f)	38.000	32.327	0,59
3,250 % fällig am 29.12.2026 (d)(f)	3.000	2.723	0,05
4,375 % fällig am 29.06.2027 (d)(f)	29.000	27.699	0,51
4,875 % fällig am 29.06.2029 (d)(f)	25.000	22.960	0,42
de Volksbank NV			
7,000 % fällig am 15.12.2027 (d)(f)	35.000	31.930	0,59
ING Groep NV			
3,875 % fällig am 16.05.2027 (d)(f)	$ 53.726	38.510	0,71
4,250 % fällig am 16.05.2031 (d)(f)	69.200	46.212	0,85
4,875 % fällig am 16.05.2029 (d)(f)	33.500	26.036	0,48
5,750 % fällig am 16.11.2026 (d)(f)	89.300	78.940	1,45
6,750 % fällig am 16.04.2024 (d)(f)	6.100	5.833	0,11
7,500 % fällig am 16.05.2028 (d)(f)	56.400	51.920	0,95
LeasePlan Corp. NV			
7,375 % fällig am 29.05.2024 (d)(f)	€ 48.500	52.021	0,95
NN Group NV			
5,250 % fällig am 01.03.2043	21.500	22.359	0,41
Stichting AK Rabobank Certificaten			
6,500 % (d)	261.437	265.193	4,87
Summe Niederlande		821.656	15,08
NORWEGEN			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
DNB Bank ASA			
5,360 % fällig am 28.08.2023 (d)	$ 8.980	7.506	0,14
5,385 % fällig am 31.08.2023 (d)(h)	2.660	2.224	0,04
5,726 % fällig am 23.08.2023 (d)(h)	18.810	15.768	0,29
Summe Norwegen		25.498	0,47
PORTUGAL			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Banco Espirito Santo S.A.			
2,625 % fällig am 08.05.2017 ^	€ 26.300	7.030	0,13
4,000 % fällig am 21.01.2019 ^	11.100	2.967	0,05
4,750 % fällig am 15.01.2018 ^	20.000	5.346	0,10
Summe Portugal		15.343	0,28
SLOWENIEN			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Nova Ljubljanska Banka d.d.			
3,400 % fällig am 05.02.2030	9.200	8.532	0,16
3,650 % fällig am 19.11.2029	5.900	5.471	0,10
10,750 % fällig am 28.11.2032	16.900	19.735	0,36
Summe Slowenien		33.738	0,62
SPANIEN			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A.			
5,875 % fällig am 24.09.2023 (d)(f)	8.200	8.875	0,16
6,000 % fällig am 29.03.2024 (d)(f)	80.800	85.498	1,57
6,000 % fällig am 15.01.2026 (d)(f)	10.000	10.264	0,19
8,375 % fällig am 21.06.2028 (d)(f)	20.200	21.956	0,40
Banco de Credito Social Cooperativo S.A.			
1,750 % fällig am 09.03.2028	11.300	10.068	0,19

BESCHREIBUNG		PAR (000S)		MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
Banco Santander S.A.					
3,625 % fällig am 21.03.2029 (d)(f)	€	36.200	$	26.089	0,48
4,125 % fällig am 12.11.2027 (d)(f)(h)		50.800		41.650	0,76
4,375 % fällig am 14.01.2026 (d)(f)		54.200		49.698	0,91
Bankinter S.A.					
6,250 % fällig am 17.01.2026 (d)(f)		11.000		11.436	0,21
7,375 % fällig am 15.08.2028 (d)(f)		8.600		8.902	0,16
CaixaBank S.A.					
3,625 % fällig am 14.09.2028 (d)(f)		61.200		45.560	0,84
5,250 % fällig am 23.03.2026 (d)(f)		11.600		10.734	0,20
5,875 % fällig am 09.10.2027 (d)(f)		13.600		13.313	0,24
6,750 % fällig am 13.06.2024 (d)(f)		72.000		76.250	1,40
8,250 % fällig am 13.03.2029 (d)(f)		29.600		31.224	0,57
Summe Spanien				451.517	8,28
SCHWEDEN					
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL					
Svenska Handelsbanken AB					
4,375 % fällig am 01.03.2027 (d)(f)	$	40.000		33.973	0,63
4,750 % fällig am 01.03.2031 (d)(f)		37.400		29.013	0,53
Swedbank AB					
4,000 % fällig am 17.03.2029 (d)(f)		3.000		2.160	0,04
Summe Schweden				65.146	1,20
SCHWEIZ					
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL					
Credit Suisse AG					
0,250 % fällig am 05.01.2026	€	450		439	0,01
0,250 % fällig am 01.09.2028		200		175	0,00
0,495 % fällig am 02.02.2024	$	600		577	0,01
1,250 % fällig am 07.08.2026		500		431	0,01
4,474 % fällig am 01.09.2023	€	800		872	0,02
4,713 % fällig am 31.05.2024		950		1.033	0,02
4,750 % fällig am 09.08.2024	$	250		244	0,00
5,000 % fällig am 09.07.2027		1.100		1.063	0,02
7,500 % fällig am 15.02.2028		550		585	0,01
7,750 % fällig am 10.03.2026	£	100		129	0,00
7,950 % fällig am 09.01.2025	$	250		255	0,00
UBS AG					
5,125 % fällig am 15.05.2024 (f)		5.000		4.924	0,09
UBS Group AG					
0,650 % fällig am 14.01.2028	€	800		751	0,01
0,650 % fällig am 10.09.2029		100		86	0,00
1,000 % fällig am 24.06.2027		200		194	0,00
1,250 % fällig am 17.07.2025		250		261	0,01
2,125 % fällig am 12.09.2025	£	200		238	0,00
2,125 % fällig am 13.10.2026	€	200		203	0,00
2,125 % fällig am 15.11.2029	£	200		199	0,00
2,250 % fällig am 09.06.2028		300		315	0,01
2,593 % fällig am 11.09.2025	$	850		811	0,02
2,746 % fällig am 11.02.2033 (h)		11.570		9.019	0,17
2,875 % fällig am 02.04.2032	€	1.200		1.143	0,02
3,091 % fällig am 14.05.2032	$	4.500		3.642	0,07
3,250 % fällig am 02.04.2026	€	1.800		1.893	0,03
3,750 % fällig am 26.03.2025	$	700		670	0,01
3,869 % fällig am 12.01.2029		300		271	0,01
4,177 % fällig am 16.01.2026	€	1.850		1.988	0,04
4,194 % fällig am 01.04.2031	$	36.000		32.061	0,59
4,282 % fällig am 09.01.2028		300		278	0,01
4,375 % fällig am 10.02.2031 (d)(f)(h)		37.135		26.252	0,48
4,375 % fällig am 10.02.2031 (d)(f)		5.100		3.605	0,07
4,550 % fällig am 17.04.2026		200		192	0,00
4,875 % fällig am 12.02.2027 (d)(f)(h)		43.100		34.611	0,64
4,875 % fällig am 12.02.2027 (d)(f)		42.500		34.130	0,63
5,959 % fällig am 12.01.2034		6.100		6.072	0,11
6,373 % fällig am 15.07.2026		850		845	0,02
6,442 % fällig am 11.08.2028		2.500		2.511	0,05
6,537 % fällig am 12.08.2033		1.050		1.076	0,02
7,000 % fällig am 19.02.2025 (d)(f)		5.737		5.474	0,10
7,000 % fällig am 30.09.2027	£	600		752	0,01
7,375 % fällig am 07.09.2033		900		1.199	0,02
7,750 % fällig am 01.03.2029	€	2.400		2.904	0,05
9,016 % fällig am 15.11.2033	$	650		780	0,01
Summe Schweiz				185.153	3,40

BESCHREIBUNG		PAR (000S)		MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
GROSSBRITANNIEN					
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL					
Barclays PLC					
2,894 % fällig am 24.11.2032	$	200	$	158	0,00
6,125 % fällig am 15.12.2025 (d)(f)		33.483		29.390	0,54
7,125 % fällig am 15.06.2025 (d)(f)	£	35.350		40.873	0,75
7,437 % fällig am 02.11.2033 (h)	$	16.000		17.319	0,32
8,000 % fällig am 15.06.2024 (d)(f)		47.524		45.024	0,83
9,250 % fällig am 15.09.2028 (d)(f)	£	19.500		22.456	0,41
Bupa Finance PLC					
4,000 % fällig am 24.09.2031 (d)(f)		6.800		5.148	0,09
HSBC Bank PLC					
5,460 % fällig am 29.09.2023 (d)(h)	$	19.480		19.480	0,36
HSBC Holdings PLC					
2,804 % fällig am 24.05.2032		200		162	0,00
5,875 % fällig am 28.09.2026 (d)(f)	£	200		222	0,00
6,000 % fällig am 29.09.2023 (d)(f)	€	36.831		39.985	0,73
6,000 % fällig am 22.05.2027 (d)(f)	$	19.300		17.298	0,32
6,161 % fällig am 09.03.2029		20.000		20.189	0,37
6,254 % fällig am 09.03.2034		1.000		1.026	0,02
6,332 % fällig am 09.03.2044		9.100		9.442	0,17
6,375 % fällig am 30.03.2025 (d)(f)		5.000		4.795	0,09
8,000 % fällig am 07.03.2028 (d)(f)(h)		35.400		35.232	0,65
Lloyds Banking Group PLC					
4,947 % fällig am 27.06.2025 (d)(f)	€	70.522		70.336	1,29
7,500 % fällig am 27.06.2024 (d)(f)	$	15.800		15.107	0,28
7,500 % fällig am 27.09.2025 (d)(f)		25.491		23.902	0,44
7,875 % fällig am 27.06.2029 (d)(f)	£	44.954		50.700	0,93
8,000 % fällig am 27.09.2029 (d)(f)	$	43.280		39.651	0,73
8,500 % fällig am 27.09.2027 (d)(f)	£	16.900		20.227	0,37
8,500 % fällig am 27.03.2028 (d)(f)		35.900		42.466	0,78
Nationwide Building Society					
5,750 % fällig am 20.06.2027 (d)(f)		19.270		21.038	0,39
NatWest Group PLC					
4,445 % fällig am 08.05.2030	$	33.800		31.099	0,57
4,500 % fällig am 31.03.2028 (d)(f)	£	18.200		17.476	0,32
4,600 % fällig am 28.06.2031 (d)(f)	$	22.659		15.748	0,29
4,892 % fällig am 18.05.2029		43.026		40.974	0,75
5,076 % fällig am 27.01.2030 (h)		11.500		10.981	0,20
5,125 % fällig am 12.05.2027 (d)(f)	£	11.150		11.720	0,22
6,000 % fällig am 29.12.2025 (d)(f)	$	69.400		64.368	1,18
8,000 % fällig am 10.08.2025 (d)(f)		19.800		19.292	0,35
Santander UK Group Holdings PLC					
2,896 % fällig am 15.03.2032		1.600		1.295	0,02
6,534 % fällig am 10.01.2029		4.600		4.636	0,09
6,750 % fällig am 24.06.2024 (d)(f)	£	89.935		107.251	1,96
Santander UK PLC					
5,000 % fällig am 07.11.2023	$	8.753		8.707	0,16
Standard Chartered PLC					
6,296 % fällig am 06.07.2034 (a)		2.600		2.606	0,05
Virgin Money UK PLC					
8,250 % fällig am 17.06.2027 (d)(f)	£	20.000		21.482	0,39
9,250 % fällig am 08.06.2024 (d)(f)		20.000		24.001	0,44
				973.262	17,85
		AKTIEN			
VORZUGSWERTPAPIERE					
Nationwide Building Society					
10,250 %		596.146		87.321	1,60
Summe Großbritannien				1.060.583	19,45
		PAR (000S)			
USA					
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL					
Bank of America Corp.					
1,843 % fällig am 04.02.2025 (h)	$	44.500		43.363	0,80
Credit Suisse AG					
AT1 Claim ^		254.548		10.182	0,19
Deutsche Postbank Funding Trust					
2,954 % fällig am 02.12.2023 (d)	€	1.704		1.303	0,02
3,125 % fällig am 07.06.2024 (d)		12.980		9.929	0,18
Doctors Co. An Interinsurance Exchange					
4,500 % fällig am 18.01.2032 (h)	$	3.400		2.699	0,05
Goldman Sachs Group, Inc.					
3,000 % fällig am 15.03.2024 (h)		7.500		7.343	0,13

BESCHREIBUNG		PAR (000S)		MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
Liberty Mutual Group, Inc.					
3,625 % fällig am 23.05.2059	€	15.500	$	16.105	0,30
Morgan Stanley					
5,948 % fällig am 19.01.2038	$	23.400		23.110	0,42
NextEra Energy Capital Holdings, Inc.					
5,650 % fällig am 01.05.2079 (h)		8.224		7.648	0,14
Summe USA				121.682	2,23
KURZFRISTIGE INSTRUMENTE					
KURZFRISTIGE SCHULDTITEL					
Federal Home Loan Bank					
5,100 % fällig am 25.08.2023		104.700		104.701	1,92
5,120 % fällig am 25.09.2023		143.100		143.111	2,63
				247.812	4,55
U.S. TREASURY BILLS					
5,127 % fällig am 12.09.2023 (b)(c)		62.500		61.867	1,13
5,139 % fällig am 12.09.2023 (b)(c)		58.800		58.205	1,07
5,143 % fällig am 12.09.2023 (b)(c)		140.800		139.375	2,56
5,150 % fällig am 03.08.2023 (b)(c)		46.600		46.395	0,85
5,161 % fällig am 08.08.2023 (b)(c)		2.800		2.786	0,05
5,183 % fällig am 15.08.2023 (b)(c)		6.900		6.858	0,13
5,189 % fällig am 10.08.2023 (b)(c)(i)		23.300		23.174	0,43
5,212 % fällig am 08.08.2023 (b)(c)		14.000		13.928	0,26
5,221 % fällig am 14.09.2023 (b)(c)		35.000		34.634	0,64
5,222 % fällig am 10.08.2023 (b)(c)(i)		27.000		26.854	0,49
5,229 % fällig am 22.08.2023 (b)(c)		98.400		97.695	1,79
5,233 % fällig am 07.09.2023 (b)(c)		18.400		18.227	0,33
5,241 % fällig am 17.08.2023 (a)(b)(c)		23.800		23.647	0,43
5,245 % fällig am 17.08.2023 (a)(b)(c)		54.900		54.546	1,00
5,256 % fällig am 17.08.2023 (a)(b)(c)		16.200		16.095	0,30
5,313 % fällig am 24.08.2023 (b)(c)		25.200		25.012	0,46
5,327 % fällig am 19.09.2023 (b)(c)(i)		10.300		10.185	0,19
5,335 % fällig am 24.08.2023 (b)(c)		19.500		19.354	0,35
5,370 % fällig am 31.08.2023 (b)(c)(i)		16.200		16.063	0,29
5,382 % fällig am 19.09.2023 (b)(c)(i)		10.600		10.481	0,19
5,406 % fällig am 26.09.2023 (b)(c)		21.200		20.943	0,38
5,421 % fällig am 26.09.2023 (b)(c)		30.800		30.427	0,56
				756.751	13,88
Summe kurzfristige Instrumente				1.004.563	18,43
Summe Übertragbare Wertpapiere				**$ 5.571.381**	**102,22**
		AKTIEN			
INVESTMENTFONDS					
ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN					
PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (e)		14.302		142	0,00
Summe Investmentfonds				**$ 142**	**0,00**

PENSIONSGESCHÄFTE

Kontrahent	Kredit-zins	Abrechnungs-datum	Fälligkeits-datum	Kapital-betrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensions-geschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensions-geschäft[1]	% des Nettovermögens
NOM	5,040 %	30.06.2023	03.07.2023	$ 25.100	U.S. Treasury Bonds 2,500 % fällig am 15.05.2046	$ (25.876)	$ 25.100	$ 25.111	0,46
Summe Pensionsgeschäfte						**$ (25.876)**	**$ 25.100**	**$ 25.111**	**0,46**

(1) Umfasst aufgelaufene Zinsen.

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

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

FUTURES

Beschreibung	Art	Ablauf-monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Canada Government 10-Year Bond September Futures	Long	09.2023	222	$ (300)	(0,01)
Euro-Bobl September Futures	Short	09.2023	442	460	0,01
Euro-Bund 10-Year Bond September Futures	Long	09.2023	1.252	(1.663)	(0,03)
Euro-Buxl 30-Year Bond September Futures	Short	09.2023	432	(997)	(0,02)
Euro-OAT France Government 10-Year Bond September Futures	Short	09.2023	1.456	1.606	0,03
Euro-Schatz September Futures	Long	09.2023	371	(356)	(0,01)
U.S. Treasury 2-Year Note September Futures	Long	09.2023	4.949	(13.643)	(0,25)
U.S. Treasury 5-Year Note September Futures	Short	09.2023	523	617	0,01
U.S. Treasury 10-Year Note September Futures	Long	09.2023	3.545	(5.789)	(0,10)
U.S. Treasury 10-Year Ultra September Futures	Short	09.2023	1.403	1.699	0,03
U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond September Futures	Long	09.2023	455	776	0,02
United Kingdom Long Gilt September Futures	Long	09.2023	422	(444)	(0,01)
				$ (18.034)	(0,33)
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate				**$ (18.034)**	**(0,33)**

ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)

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

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMMISSIONEN - SCHUTZVERKAUF[1]

Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag[2]	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Jaguar Land Rover Automotive PLC	5,000 %	20.06.2027	€ 20.000	$ 1.279	0,02

ZINSSWAPS

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Erhalt	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	0,750 %	15.09.2051	£ 3.800	$ 1.439	0,03
Erhalt[3]	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	3,250	20.09.2053	31.100	2.055	0,04
Erhalt[3]	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	3,500	20.09.2033	93.100	6.895	0,13
Erhalt[3]	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	3,750	20.09.2028	43.900	3.107	0,06
Zahlung[3]	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	4,000	20.09.2025	21.100	(778)	(0,02)
Erhalt[3]	6-Month EUR-EURIBOR	2,500	20.09.2053	€ 64.900	(373)	(0,01)
					$ 12.345	0,23
Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate					**$ 13.624**	**0,25**

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

(2) Der maximal mögliche Betrag, den der Fonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

(3) Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft.

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

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

DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung		Zu erhaltende Währung		Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
AZD	07.2023	$	124	AUD	187	$ 0	$ 0	$ 0	0,00
	08.2023	AUD	187	$	124	0	0	0	0,00
BOA	07.2023	CAD	20.676		15.195	0	(430)	(430)	(0,01)
	07.2023	€	258.345		277.698	5	(4.162)	(4.157)	(0,07)
	07.2023	SEK	95		9	0	0	0	0,00
	07.2023	$	10.737	€	9.927	93	0	93	0,00
	07.2023		3.135	£	2.484	23	0	23	0,00
	08.2023		49	CNY	335	0	(2)	(2)	0,00
BPS	07.2023	AUD	70	$	46	0	(1)	(1)	0,00
	07.2023	€	1.719.265		1.848.252	0	(27.468)	(27.468)	(0,50)
	07.2023	£	1.847		2.284	0	(64)	(64)	0,00
	07.2023	$	89	AUD	134	0	0	0	0,00
	07.2023		39.386	€	36.578	554	(34)	520	0,01
	08.2023	AUD	134	$	89	0	0	0	0,00
	08.2023	$	58	CNY	394	0	(3)	(3)	0,00
BRC	07.2023	£	28.263	$	35.167	0	(765)	(765)	(0,01)
	07.2023	$	21.176	£	16.634	0	(28)	(28)	0,00
CBK	07.2023	€	23.520	$	25.351	14	(323)	(309)	(0,01)
	07.2023	£	4.999		6.309	0	(47)	(47)	0,00
	07.2023	$	307.242	€	282.810	1.305	0	1.305	0,03
	07.2023		20.507	£	16.126	7	(12)	(5)	0,00
	08.2023	CNH	268	$	38	1	0	1	0,00
	08.2023	€	254.332		276.900	0	(956)	(956)	(0,02)
DUB	07.2023	AUD	446		307	10	0	10	0,00
JPM	07.2023	€	6.538		6.990	0	(143)	(143)	0,00
	07.2023	SGD	1.765		1.336	31	0	31	0,00
	07.2023	$	1.804.057	€	1.652.218	0	(1.486)	(1.486)	(0,03)
	07.2023		571.634	£	452.099	3.143	0	3.143	0,06
	08.2023	€	1.652.218	$	1.806.580	1.541	0	1.541	0,03
	08.2023	£	452.099		571.755	0	(3.136)	(3.136)	(0,06)
	08.2023	$	61	CNY	415	0	(3)	(3)	0,00
MBC	07.2023	CAD	716	$	528	0	(13)	(13)	0,00
	07.2023	€	6.910		7.394	0	(144)	(144)	0,00
	07.2023	£	328.949		407.242	0	(10.968)	(10.968)	(0,20)
	07.2023	$	28.387	€	26.125	197	(82)	115	0,00
	07.2023		1.259	£	985	0	(7)	(7)	0,00
MYI	07.2023	€	1.493	$	1.636	7	0	7	0,00
	07.2023	£	130.807		162.576	0	(3.726)	(3.726)	(0,07)
	07.2023	SEK	4.786		446	3	0	3	0,00
	07.2023	$	38.345	€	35.336	206	0	206	0,00
	07.2023		5.069	£	4.072	108	0	108	0,00
	07.2023		453	SEK	4.888	0	0	0	0,00
	08.2023	SEK	4.882	$	453	0	0	0	0,00
RBC	07.2023	£	164		210	1	0	1	0,00
SCX	07.2023	$	182	AUD	275	0	0	0	0,00
	08.2023	AUD	275	$	183	0	(1)	(1)	0,00
	08.2023	$	42	CNH	290	0	(2)	(2)	0,00
SOG	07.2023	AUD	296	$	194	0	(3)	(3)	0,00
TOR	07.2023	$	223	AUD	338	2	0	2	0,00
	07.2023		16.168	CAD	21.393	11	(12)	(1)	0,00
	08.2023	AUD	338	$	224	0	(2)	(2)	0,00
	08.2023	CAD	21.385		16.168	12	(11)	1	0,00
UAG	07.2023	AUD	306		200	0	(3)	(3)	0,00
	07.2023	€	26.170		28.016	0	(536)	(536)	(0,01)
	07.2023	$	108	AUD	163	1	0	1	0,00
	08.2023	AUD	163	$	108	0	(1)	(1)	0,00
	09.2023	$	15	SGD	21	0	0	0	0,00
						$ 7.275	$ (54.574)	$ (47.299)	(0,86)

ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilklassen Investor AUD (Hedged) ausschüttend und die Z AUD (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung		Zu erhaltende Währung		Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
AZD	07.2023	AUD	5.006	$	3.322	$ 0	$ (10)	$ (10)	0,00
	07.2023	$	6.073	AUD	9.279	104	0	104	0,00
	08.2023		3.325		5.006	10	0	10	0,00
BOA	07.2023	AUD	425	$	286	4	0	4	0,00
	07.2023	$	12.486	AUD	19.198	293	0	293	0,01
BPS	07.2023	AUD	26.037	$	17.248	0	(84)	(84)	0,00
	07.2023	$	370	AUD	567	7	0	7	0,00
	08.2023		16.984		25.620	84	0	84	0,00
CBK	07.2023	AUD	817	$	556	12	0	12	0,00

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
	07.2023	$ 4.143	AUD 6.350	$ 84	$ 0	$ 84	0,00
JPM	07.2023	6.307	9.647	115	0	115	0,00
MBC	07.2023	AUD 193	$ 128	0	(1)	(1)	0,00
RBC	07.2023	127	87	2	0	2	0,00
SCX	07.2023	8.831	5.863	0	(16)	(16)	0,00
	07.2023	$ 5.029	AUD 7.696	94	0	94	0,00
	08.2023	5.867	8.831	16	0	16	0,00
SOG	07.2023	10.043	15.350	175	0	175	0,00
TOR	07.2023	AUD 15.420	$ 10.185	0	(79)	(79)	0,00
	07.2023	$ 10.670	AUD 16.314	189	0	189	0,01
	08.2023	10.193	15.420	79	0	79	0,00
UAG	07.2023	AUD 29.991	$ 19.917	41	(87)	(46)	0,00
	07.2023	$ 4.861	AUD 7.426	82	0	82	0,00
	08.2023	19.744	29.713	88	(38)	50	0,00
				$ 1.479	$ (315)	$ 1.164	0,02

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklasse Institutional BRL (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2023	BRL 162	$ 32	$ 0	$ (1)	$ (1)	0,00
BPS	07.2023	21.681	4.538	44	(1)	43	0,00
	07.2023	$ 32	BRL 152	0	0	0	0,00
	08.2023	BRL 478	$ 100	1	0	1	0,00
	08.2023	$ 4.105	BRL 19.713	0	(39)	(39)	0,00
CBK	07.2023	BRL 20.452	$ 4.277	37	0	37	0,00
	07.2023	$ 4.488	BRL 22.477	171	0	171	0,00
	08.2023	4.255	20.452	0	(36)	(36)	0,00
GLM	07.2023	4.783	23.958	184	0	184	0,01
JPM	07.2023	BRL 8.794	$ 1.812	7	(18)	(11)	0,00
	07.2023	$ 4.844	BRL 24.248	183	0	183	0,00
	08.2023	BRL 76	$ 16	0	0	0	0,00
TOR	07.2023	19.748	4.116	23	0	23	0,00
	08.2023	$ 4.095	BRL 19.748	0	(21)	(21)	0,00
				$ 650	$ (116)	$ 534	0,01

Zum 30. Juni 2023 standen für die ausschüttende Investor CAD (Hedged) Class die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2023	$ 975	CAD 1.326	$ 27	$ 0	$ 27	0,00
CBK	07.2023	957	1.304	28	0	28	0,00
MBC	07.2023	28	38	1	0	1	0,00
MYI	07.2023	CAD 43	$ 32	0	0	0	0,00
SCX	07.2023	$ 980	CAD 1.332	26	0	26	0,00
				$ 82	$ 0	$ 82	0,00

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklassen Institutional CHF (Hedged) thesaurierend und Class E CHF (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2023	CHF 88	$ 98	$ 0	$ 0	$ 0	0,00
	07.2023	$ 659	CHF 590	1	0	1	0,00
BPS	07.2023	CHF 14.388	$ 16.087	5	0	5	0,00
	07.2023	$ 20.651	CHF 18.681	229	0	229	0,01
	08.2023	16.016	14.283	0	(5)	(5)	0,00
CLY	07.2023	CHF 7.571	$ 8.428	0	(34)	(34)	0,00
	08.2023	$ 8.428	CHF 7.549	34	0	34	0,00
JPM	07.2023	CHF 314	$ 348	0	(4)	(4)	0,00
MBC	07.2023	201	224	0	0	0	0,00
	07.2023	$ 22	CHF 20	0	0	0	0,00
MYI	07.2023	CHF 57	$ 63	0	(1)	(1)	0,00
	07.2023	$ 350	CHF 317	4	0	4	0,00
RYL	07.2023	CHF 11	$ 12	0	0	0	0,00
SCX	07.2023	181	199	0	(3)	(3)	0,00
	07.2023	$ 15.535	CHF 13.958	67	0	67	0,00
UAG	07.2023	CHF 14.805	$ 16.516	0	(33)	(33)	0,00
	07.2023	$ 14.216	CHF 12.773	61	0	61	0,00
	08.2023	16.516	14.763	33	0	33	0,00
				$ 434	$ (80)	$ 354	0,01

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklassen Institutional EUR (Hedged) thesaurierend, Institutional EUR (Hedged) ausschüttend, Institutional EUR (Hedged) ausschüttend II, Investor EUR (Hedged) thesaurierend, Administrative EUR (Hedged) thesaurierend, Class E EUR (Hedged) thesaurierend, Class E EUR (Hedged) ausschüttend, Class R EUR (Hedged) ausschüttend und Class T EUR (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2023	€ 450	$ 491	$ 1	$ 0	$ 1	0,00
	07.2023	$ 793.672	€ 738.470	12.000	0	12.000	0,22
BPS	07.2023	€ 728.477	$ 798.180	3.413	(2)	3.411	0,06
	07.2023	$ 787.788	€ 732.820	11.721	0	11.721	0,21
	08.2023	795.650	725.139	0	(3.442)	(3.442)	(0,06)
CBK	07.2023	€ 727.517	$ 790.962	0	(2.760)	(2.760)	(0,05)
	07.2023	$ 13.694	€ 12.758	224	0	224	0,00
	08.2023	790.649	726.210	2.731	0	2.731	0,05
JPM	07.2023	€ 726.210	$ 792.948	653	0	653	0,01
	08.2023	$ 794.057	€ 726.210	0	(677)	(677)	(0,01)
MBC	07.2023	€ 23.655	$ 25.597	28	(239)	(211)	0,00
	07.2023	$ 3.667	€ 3.429	73	0	73	0,00
SOG	07.2023	788.324	732.820	11.184	0	11.184	0,21
				$ 42.028	$ (7.120)	$ 34.908	0,64

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklassen Institutional GBP (Hedged) thesaurierend, Institutional GBP (Hedged) ausschüttend, Investor GBP (Hedged) ausschüttend und Class R GBP (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2023	$ 155	£ 123	$ 1	$ 0	$ 1	0,00
BPS	07.2023	£ 348	$ 437	2	(7)	(5)	0,00
	07.2023	$ 51.481	£ 41.622	1.435	0	1.435	0,02
BRC	07.2023	£ 161	$ 204	0	(1)	(1)	0,00
	07.2023	$ 348	£ 274	0	0	0	0,00
CBK	07.2023	£ 266	$ 336	0	(2)	(2)	0,00
	07.2023	$ 117	£ 93	1	0	1	0,00
JPM	07.2023	£ 41.953	$ 53.046	0	(292)	(292)	(0,01)
	08.2023	$ 53.057	£ 41.953	291	0	291	0,01
MBC	07.2023	53.170	42.946	1.430	0	1.430	0,03
MYI	07.2023	52.413	42.171	1.202	0	1.202	0,02
TOR	07.2023	£ 41.982	$ 53.346	0	(27)	(27)	0,00
	08.2023	$ 53.358	£ 41.982	26	0	26	0,00
				$ 4.388	$ (329)	$ 4.059	0,07

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklassen Institutional SGD (Hedged) Income, Investor SGD (Hedged) Income, Administrative SGD (Hedged) Income II und M Retail SGD (Hedged) Income II die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BRC	07.2023	$ 24.236	SGD 32.795	$ 0	$ (4)	$ (4)	0,00
GLM	07.2023	SGD 320	$ 238	1	0	1	0,00
	07.2023	$ 340	SGD 457	0	(3)	(3)	0,00
JPM	07.2023	SGD 31.840	$ 23.529	3	0	3	0,00
	07.2023	$ 2.141	SGD 2.898	0	0	0	0,00
	08.2023	23.529	31.809	0	(2)	(2)	0,00
MBC	07.2023	22.109	29.872	0	(37)	(37)	0,00
	08.2023	SGD 292	$ 216	0	0	0	0,00
MYI	07.2023	31.368	23.214	37	(1)	36	0,00
	08.2023	$ 22.780	SGD 30.752	0	(34)	(34)	0,00
UAG	07.2023	SGD 249	$ 184	0	0	0	0,00
	07.2023	$ 23.857	SGD 32.273	0	(10)	(10)	0,00
				$ 41	$ (91)	$ (50)	0,00

Summe Freiverkehrsfinanzderivate	**$ (6.248)**	**(0,11)**
Summe Anlagen	**$ 5.585.965**	**102,49**
Sonstige Aktiva und Passiva	**$ (135.963)**	**(2,49)**
Nettovermögen	**$ 5.450.002**	**100,00**

ERLÄUTERUNGEN ZUR AUFSTELLUNG DES WERTPAPIERBESTANDS (Angaben in Tausend*):

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

^ **Das Wertpapier ist in Verzug.**

(a) **Wertpapier per Emissionstermin.**

(b) **Nullkuponwertpapier.**

(c) **Der Kupon stellt eine Rendite bis zur Endfälligkeit dar.**

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

(e) **Mit dem Fonds verbunden.**

(f) Bedingt wandelbares Wertpapier.

(g) Eingeschränkte Wertpapiere (31. Dezember 2022: 0,66 %):

Emittentenbeschreibung	Kupon	Fälligkeits-datum	Kauf-datum	Kosten	Markt-wert	% des Nettovermögens
Bank of Nova Scotia	3,625 %	27.10.2081	29.09.2021	$ 19.200	$ 13.587	0,25
Deutsche Bank AG	3,729	14.01.2032	17.10.2022 - 24.01.2023	10.466	10.198	0,19
				$ 29.666	$ 23.785	0,44

(h) Wertpapiere mit einem gesamten beizulegenden Zeitwert von 290.514 USD (31. Dezember 2022: 627.510 USD) wurden zum 30. Juni 2023 gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte als Sicherheit verpfändet.

(i) Wertpapiere mit einem gesamten beizulegenden Zeitwert von 9.837 USD (31. Dezember 2022: null USD) und Barmittel in Höhe von 12.150 USD (31. Dezember 2022: 29.992 USD) wurden zum 30. Juni 2023 gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. als Sicherheit für Finanzderivate verpfändet.

Barmittel in Höhe von 8.540 USD (31. Dezember 2022: 18.271 USD) wurden zum 30. Juni 2023 gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte als Sicherheit geliefert.

Barmittel in Höhe von 62.214 USD (31. Dezember 2022: 80.890 USD) wurden zum 30. Juni 2023 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Beizulegender Zeitwert[1]

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 30. Juni 2023 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie[2]	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	$ 0	$ 5.570.373	$ 1.008	$ 5.571.381
Investmentfonds	142	0	0	142
Pensionsgeschäfte	0	25.100	0	25.100
Finanzderivate[3]	(1.694)	(8.964)	0	(10.658)
Summen	**$ (1.552)**	**$ 5.586.509**	**$ 1.008**	**$ 5.585.965**

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

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

(1) Siehe Erläuterung 3 in den Erläuterungen zum Abschluss für weitere Informationen.

(2) Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung des Wertpapierbestands.

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

Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2023:

Kontrahent	Kredit-zins	Abrechnungs-datum	Fälligkeits-datum	Kredit-betrag	Verbindlichkeiten aus umgekehrten Pensions-geschäften	% des Nettovermögens
BPS	3,500 %	10.05.2023	TBD[1]	€ (6.429)	$ (7.048)	(0,13)
	5,480	23.05.2023	07.07.2023	$ (30.710)	(30.892)	(0,57)
BRC	3,450	10.05.2023	TBD[1]	€ (4.445)	(4.872)	(0,09)
JML	5,050	22.03.2023	06.07.2023	$ (25.517)	(25.878)	(0,47)
	5,590	06.01.2023	06.07.2023	(61.405)	(62.975)	(1,15)
	5,590	02.03.2023	06.07.2023	(12.164)	(12.383)	(0,23)
	5,590	08.03.2023	06.07.2023	(12.726)	(12.945)	(0,24)
	5,590	22.03.2023	06.07.2023	(3.676)	(3.732)	(0,07)
NOM	4,250	08.05.2023	TBD[1]	(4.738)	(4.768)	(0,09)
SCX	5,270	10.04.2023	10.07.2023	(34.615)	(35.030)	(0,64)
	5,270	15.06.2023	10.07.2023	(36.339)	(36.425)	(0,67)
	5,340	10.04.2023	10.07.2023	(16.238)	(16.435)	(0,30)
Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte					**$ (253.383)**	**(4,65)**

(1) Umgekehrtes Pensionsgeschäft mit offener Laufzeit.

Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC-Finanzderivate und -Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2023 und 31. Dezember 2022:

	Zum 30. Jun. 2023			Zum 31. Dez. 2022		
Kontrahent	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-engagement[1]	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-engagement[1]
AZD	$ 104	$ (80)	$ 24	$ 137	$ 0	$ 137
BOA	7.853	(5.909)	1.944	1.028	(1.010)	18
BPS	(13.655)	12.150	(1.505)	(1.308)	1.490	182
BRC	(798)	709	(89)	37	(10)	27
CBK	479	(300)	179	6.857	(6.830)	27
DUB	10	0	10	k. A.	k. A.	k. A.
GLM	182	0	182	352	(400)	(48)
GST	k. A.	k. A.	k. A.	(268)	262	(6)
JPM	206	(290)	(84)	175	(340)	(165)
MBC	(9.762)	7.291	(2.471)	14.804	(13.250)	1.554
MYI	(2.195)	1.516	(679)	771	(650)	121
RBC	3	0	3	34	0	34
SCX	181	(290)	(109)	(28.111)	26.890	(1.221)
SOG	11.356	(8.370)	2.986	k. A.	k. A.	k. A.
TOR	190	(280)	(90)	(140)	1.350	1.210
UAG	(402)	321	(81)	(147)	0	(147)

[1] Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären.

Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung des Wertpapierbestandszum 30. Juni 2023:

	30. Jun. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	84,71	82,69
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	17,32	24,44
Sonstige übertragbare Wertpapiere	0,19	k. A.
Investmentfonds	0,00	0,00
Pensionsgeschäfte	0,46	0,18
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	(0,33)	0,42
Zentral abgerechnete Finanzderivate	0,25	0,05
Freiverkehrsfinanzderivate	(0,11)	(0,10)
Umgekehrte Pensionsgeschäfte	(4,65)	(10,11)

Das Anlageportfolio des Fonds konzentriert sich zum 30. Juni 2023 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	30. Jun. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
Österreich	1,50	1,85
Belgien	1,42	1,41
Kanada	1,23	1,20
Cayman-Inseln	k. A.	0,11
China	k. A.	0,01
Dänemark	0,47	0,44
Finnland	0,80	0,82
Frankreich	12,35	13,26
Deutschland	2,55	3,81
Hongkong	0,19	0,12
Irland	3,38	3,56
Israel	k. A.	0,26
Italien	7,11	7,66
Jersey, Kanalinseln	1,65	1,51
Luxemburg	0,13	0,64
Mexiko	k. A.	0,71
Niederlande	15,08	15,07
Norwegen	0,47	0,36
Portugal	0,28	0,16
Slowenien	0,62	0,60
Spanien	8,28	8,65
Schweden	1,20	0,72
Schweiz	3,40	7,67
Großbritannien	19,45	18,81
USA	2,23	1,51
Kurzfristige Instrumente	18,43	16,21
Investmentfonds	0,00	0,00
Pensionsgeschäfte	0,46	0,18
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	(0,33)	0,42
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	0,02	(0,03)
Zinsswaps	0,23	0,08
Freiverkehrsfinanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	k. A.	(0,04)
Devisenterminkontrakte	(0,86)	(1,11)
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	0,75	1,05
Sonstige Aktiva und Passiva	(2,49)	(7,68)
Nettovermögen	100,00	100,00

BESCHREIBUNG		PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE				
AUSTRALIEN				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
GPT Wholesale Office Fund				
3,222 % fällig am 05.11.2031	AUD	500	$ 259	0,09
Lendlease Finance Ltd.				
3,400 % fällig am 27.10.2027		930	544	0,19
3,700 % fällig am 31.03.2031		200	104	0,03
Summe Australien			907	0,31
ÖSTERREICH				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Erste Group Bank AG				
0,125 % fällig am 17.05.2028	€	700	631	0,22
UniCredit Bank Austria AG				
3,125 % fällig am 21.09.2029		600	645	0,22
Summe Österreich			1.276	0,44
BELGIEN				
STAATSEMISSIONEN				
Belgium Government International Bond				
2,750 % fällig am 22.04.2039		700	714	0,25
Ministeries van de Vlaamse Gemeenschap				
3,250 % fällig am 12.01.2043		500	518	0,18
Summe Belgien			1.232	0,43
KANADA				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Brookfield Property Finance ULC				
7,125 % fällig am 13.02.2028 (e)	CAD	700	490	0,17
STAATSEMISSIONEN				
Canada Government International Bond				
2,250 % fällig am 01.12.2029		6.400	4.521	1,56
Summe Kanada			5.011	1,73
CHILE				
STAATSEMISSIONEN				
Chile Government International Bond				
0,830 % fällig am 02.07.2031	€	2.100	1.808	0,63
3,500 % fällig am 15.04.2053	$	400	299	0,10
Summe Chile			2.107	0,73
ZYPERN				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Atrium Finance PLC				
2,625 % fällig am 05.09.2027	€	1.100	875	0,30
TSCHECHISCHE REPUBLIK				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
UniCredit Bank Czech Republic & Slovakia A/S				
3,750 % fällig am 20.06.2028		600	648	0,22
DÄNEMARK				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Danske Bank A/S				
4,750 % fällig am 21.06.2030		700	762	0,26
Pandora A/S				
4,500 % fällig am 10.04.2028		400	435	0,15
TDC Net A/S				
5,618 % fällig am 06.02.2030		1.900	2.036	0,71
Summe Dänemark			3.233	1,12
FINNLAND				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Nokia Oyj				
4,375 % fällig am 21.08.2031		500	538	0,18
Nordea Bank Abp				
6,000 % fällig am 02.06.2026	£	1.800	2.249	0,78
Tornator Oyj				
1,250 % fällig am 14.10.2026	€	200	197	0,07
			2.984	1,03

BESCHREIBUNG		PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
STAATSEMISSIONEN				
Kundarahoitus Oyj				
3,000 % fällig am 25.09.2028	€	500	$ 540	0,19
Summe Finnland			3.524	1,22
FRANKREICH				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
AXA S.A.				
5,500 % fällig am 11.07.2043		400	437	0,15
Banque Federative du Credit Mutuel S.A.				
0,250 % fällig am 29.06.2028		100	91	0,03
BNP Paribas S.A.				
0,500 % fällig am 04.06.2026		2.900	2.945	1,02
1,675 % fällig am 30.06.2027	$	500	441	0,15
4,625 % fällig am 25.02.2031 (c)(d)		1.000	716	0,25
CNP Assurances				
2,000 % fällig am 27.07.2050	€	200	174	0,06
4,875 % fällig am 07.10.2030 (c)(d)	$	800	598	0,21
Credit Agricole S.A.				
0,125 % fällig am 09.12.2027	€	100	92	0,03
Forvia				
2,750 % fällig am 15.02.2027		500	496	0,17
Ile-de-France Mobilites				
0,400 % fällig am 28.05.2031		800	705	0,24
Schneider Electric SE				
3,250 % fällig am 12.06.2028		1.200	1.294	0,45
SEB S.A.				
1,375 % fällig am 16.06.2025		600	619	0,21
Societe Generale S.A.				
0,625 % fällig am 02.12.2027		1.200	1.135	0,39
			9.743	3,36
STAATSEMISSIONEN				
Agence Francaise de Developpement				
1,375 % fällig am 17.09.2024		1.000	1.061	0,37
3,500 % fällig am 25.02.2033		800	888	0,31
France Government International Bond				
0,500 % fällig am 25.06.2044		850	550	0,19
Regie Autonome des Transports Parisiens				
3,250 % fällig am 11.04.2033		1.400	1.514	0,52
Region of Ile de France				
3,050 % fällig am 03.02.2033		200	215	0,07
Societe Du Grand Paris EPIC				
0,300 % fällig am 25.11.2031		1.900	1.623	0,56
1,000 % fällig am 18.02.2070		100	45	0,02
3,500 % fällig am 25.05.2043		500	531	0,18
Societe Nationale SNCF S.A.				
0,625 % fällig am 17.04.2030		800	730	0,25
3,125 % fällig am 02.11.2027		900	968	0,34
3,375 % fällig am 25.05.2033		800	874	0,30
			8.999	3,11
Summe Frankreich			18.742	6,47
DEUTSCHLAND				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Amprion GmbH				
3,450 % fällig am 22.09.2027		200	214	0,07
Commerzbank AG				
3,000 % fällig am 14.09.2027		500	512	0,18
3,375 % fällig am 12.12.2025		700	757	0,26
Deutsche Bahn Finance GmbH				
0,625 % fällig am 08.12.2050		50	28	0,01
3,250 % fällig am 19.05.2033		600	645	0,22
Deutsche Bank AG				
1,875 % fällig am 23.02.2028		1.900	1.837	0,64
E.ON SE				
3,875 % fällig am 12.01.2035		500	543	0,19
Kreditanstalt fuer Wiederaufbau				
0,000 % fällig am 15.09.2028 (b)		100	93	0,03
1,375 % fällig am 07.06.2032		15.600	14.979	5,17
2,000 % fällig am 15.11.2029		10.400	10.702	3,70
Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG in Muenchen				
1,000 % fällig am 26.05.2042		700	552	0,19

BESCHREIBUNG		PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
Schaeffler AG				
3,375 % fällig am 12.10.2028	€	1.700	$ 1.696	0,59
Vonovia SE				
2,375 % fällig am 25.03.2032		1.600	1.424	0,49
ZF Finance GmbH				
2,000 % fällig am 06.05.2027		800	762	0,26
2,250 % fällig am 03.05.2028		600	553	0,19
			35.297	12,19
STAATSEMISSIONEN				
Bundesrepublik Deutschland				
0,000 % fällig am 15.08.2031 (b)		1.400	1.266	0,43
Land Nordrhein-Westfalen				
0,000 % fällig am 12.10.2035 (b)		20	15	0,01
			1.281	0,44
Summe Deutschland			36.578	12,63
HONGKONG				
STAATSEMISSIONEN				
Hong Kong Government International Bond				
5,250 % fällig am 11.01.2053	$	700	783	0,27
INDIEN				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
JSW Hydro Energy Ltd.				
4,125 % fällig am 18.05.2031		1.176	993	0,34
ReNew Power Pvt Ltd.				
5,875 % fällig am 05.03.2027		837	785	0,27
ReNew Wind Energy AP2				
4,500 % fällig am 14.07.2028		1.700	1.450	0,50
Summe Indien			3.228	1,11
IRLAND				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
AIB Group PLC				
2,875 % fällig am 30.05.2031	€	600	594	0,21
4,625 % fällig am 23.07.2029		1.300	1.394	0,48
Bank of Ireland Group PLC				
5,000 % fällig am 04.07.2031 (a)		400	436	0,15
6,253 % fällig am 16.09.2026	$	800	795	0,27
7,594 % fällig am 06.12.2032	£	600	731	0,25
Smurfit Kappa Treasury ULC				
0,500 % fällig am 22.09.2029	€	1.000	885	0,31
Zurich Finance Ireland Designated Activity Co.				
3,000 % fällig am 19.04.2051	$	650	510	0,18
3,500 % fällig am 02.05.2052		1.200	956	0,33
Summe Irland			6.301	2,18
ITALIEN				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Ferrovie dello Stato Italiane SpA				
3,750 % fällig am 14.04.2027	€	1.200	1.288	0,44
UniCredit SpA				
5,850 % fällig am 15.11.2027		2.200	2.459	0,85
			3.747	1,29
STAATSEMISSIONEN				
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro				
1,500 % fällig am 30.04.2045		1.050	709	0,25
4,000 % fällig am 30.10.2031		400	440	0,15
			1.149	0,40
Summe Italien			4.896	1,69
JAPAN				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc.				
0,848 % fällig am 19.07.2029		800	739	0,26
Mizuho Financial Group, Inc.				
3,490 % fällig am 05.09.2027		1.300	1.380	0,48
Norinchukin Bank				
2,080 % fällig am 22.09.2031	$	1.000	804	0,28
4,867 % fällig am 14.09.2027		600	591	0,20

BESCHREIBUNG		PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
NTT Finance Corp.				
0,399 % fällig am 13.12.2028	€	1.300	$ 1.199	0,41
4,239 % fällig am 25.07.2025	$	2.900	2.822	0,98
Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc.				
2,472 % fällig am 14.01.2029		1.300	1.110	0,38
Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd.				
2,800 % fällig am 10.03.2027		800	736	0,25
			9.381	3,24
STAATSEMISSIONEN				
Japan Finance Organization for Municipalities				
0,010 % fällig am 02.02.2028	€	400	372	0,13
3,375 % fällig am 22.02.2028		500	540	0,18
			912	0,31
Summe Japan			10.293	3,55
JERSEY, KANALINSELN				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Aptiv PLC				
3,100 % fällig am 01.12.2051	$	200	126	0,05
4,350 % fällig am 15.03.2029		1.000	961	0,33
Summe Jersey, Kanalinseln			1.087	0,38
LUXEMBURG				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Acef Holding S.C.A.				
0,750 % fällig am 14.06.2028	€	1.600	1.430	0,49
CBRE Global Investors Open-Ended Fund S.C.A. SICAV-SIF Pan European Core Fund				
0,500 % fällig am 27.01.2028		1.200	1.036	0,36
0,900 % fällig am 12.10.2029		1.000	799	0,28
CPI Property Group S.A.				
1,750 % fällig am 14.01.2030		600	397	0,14
2,750 % fällig am 22.01.2028	£	400	341	0,12
Logicor Financing SARL				
2,000 % fällig am 17.01.2034	€	1.100	798	0,27
Prologis International Funding S.A.				
0,750 % fällig am 23.03.2033		475	353	0,12
0,875 % fällig am 09.07.2029		125	109	0,04
1,625 % fällig am 17.06.2032		1.425	1.188	0,41
3,625 % fällig am 07.03.2030		200	204	0,07
Segro Capital SARL				
0,500 % fällig am 22.09.2031		1.000	781	0,27
SELP Finance SARL				
0,875 % fällig am 27.05.2029		1.500	1.280	0,44
Summe Luxemburg			8.716	3,01
MAURITIUS				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
India Green Power Holdings				
4,000 % fällig am 22.02.2027	$	400	350	0,12
MEXIKO				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Nemak S.A.B. de C.V.				
2,250 % fällig am 20.07.2028	€	1.000	888	0,31
MULTINATIONAL				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC				
2,000 % fällig am 01.09.2028		500	455	0,16
3,000 % fällig am 01.09.2029		150	122	0,04
NXP BV				
2,500 % fällig am 11.05.2031	$	1.200	979	0,34
Summe multinational			1.556	0,54
NIEDERLANDE				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
ABN AMRO Bank NV				
2,470 % fällig am 13.12.2029		2.400	2.012	0,69
5,250 % fällig am 26.05.2026	£	400	492	0,17
Arcadis NV				
4,875 % fällig am 28.02.2028	€	400	437	0,15
CTP NV				
1,250 % fällig am 21.06.2029	€	2.000	$ 1.585	0,55
Digital Intrepid Holding BV				
0,625 % fällig am 15.07.2031		1.500	1.139	0,39
DSV Finance BV				
0,500 % fällig am 03.03.2031		500	430	0,15
EnBW International Finance BV				
3,625 % fällig am 22.11.2026		500	542	0,19
Enel Finance International NV				
0,000 % fällig am 17.06.2027 (b)		600	563	0,19
1,375 % fällig am 12.07.2026	$	1.000	883	0,31
7,500 % fällig am 14.10.2032		500	555	0,19
ING Groep NV				
1,125 % fällig am 07.12.2028	£	200	200	0,07
4,875 % fällig am 16.05.2029 (c)(d)	$	2.000	1.554	0,54
JDE Peet's NV				
2,250 % fällig am 24.09.2031		1.000	775	0,27
LeasePlan Corp. NV				
0,250 % fällig am 23.02.2026	€	2.000	1.957	0,68
0,250 % fällig am 07.09.2026		1.400	1.345	0,46
1,375 % fällig am 07.03.2024		100	107	0,04
3,500 % fällig am 09.04.2025		700	750	0,26
Nationale-Nederlanden Bank NV				
0,500 % fällig am 21.09.2028		1.100	995	0,34
1,875 % fällig am 17.05.2032		200	195	0,07
NE Property BV				
2,000 % fällig am 20.01.2030		1.400	1.130	0,39
Sika Capital BV				
3,750 % fällig am 03.11.2026		400	434	0,15
TenneT Holding BV				
4,500 % fällig am 28.10.2034		700	815	0,28
Thermo Fisher Scientific Finance BV				
0,000 % fällig am 18.11.2025 (b)		1.400	1.393	0,48
VIA Outlets BV				
1,750 % fällig am 15.11.2028		1.100	965	0,33
Wabtec Transportation Netherlands BV				
1,250 % fällig am 03.12.2027		1.900	1.802	0,62
			23.055	7,96
STAATSEMISSIONEN				
Nederlandse Waterschapsbank NV				
3,000 % fällig am 20.04.2033		900	974	0,34
Summe Niederlande			24.029	8,30
NORWEGEN				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
DNB Bank ASA				
3,625 % fällig am 16.02.2027		1.700	1.817	0,63
SINGAPUR				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Clean Renewable Power Mauritius Pte. Ltd.				
4,250 % fällig am 25.03.2027	$	651	572	0,20
SÜDKOREA				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
SK Hynix, Inc.				
2,375 % fällig am 19.01.2031		300	232	0,08
6,375 % fällig am 17.01.2028		700	703	0,24
			935	0,32
STAATSEMISSIONEN				
Korea Water Resources Corp.				
3,500 % fällig am 27.04.2025		700	675	0,24
Summe Südkorea			1.610	0,56
SPANIEN				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Banco Santander S.A.				
0,625 % fällig am 24.06.2029	€	900	815	0,28
CaixaBank S.A.				
0,500 % fällig am 09.02.2029		100	91	0,03
1,500 % fällig am 03.12.2026	£	600	659	0,23
3,750 % fällig am 07.09.2029	€	1.900	2.050	0,71
Caja Rural de Navarra SCC				
3,000 % fällig am 26.04.2027	€	2.100	$ 2.230	0,77
			5.845	2,02
STAATSEMISSIONEN				
Autonomous Community of Madrid				
3,596 % fällig am 30.04.2033		300	328	0,11
Spain Government International Bond				
1,000 % fällig am 30.07.2042		1.700	1.170	0,40
Xunta de Galicia				
0,084 % fällig am 30.07.2027		50	47	0,02
			1.545	0,53
Summe Spanien			7.390	2,55
SUPRANATIONAL				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Eurofima Europäische Gesellschaft für die Finanzierung von Eisenbahnmaterial				
0,000 % fällig am 28.07.2026 (b)		100	98	0,03
0,010 % fällig am 23.06.2028		2.000	1.849	0,64
0,150 % fällig am 10.10.2034		500	392	0,14
3,125 % fällig am 09.11.2031		800	868	0,30
Europäische Investitionsbank				
0,750 % fällig am 15.07.2027	AUD	500	287	0,10
1,500 % fällig am 15.06.2032	€	5.600	5.389	1,86
2,250 % fällig am 15.03.2030		1.230	1.278	0,44
3,750 % fällig am 14.02.2033	$	5.000	4.929	1,70
Europäische Union				
0,000 % fällig am 04.10.2030 (b)	€	1.400	1.233	0,43
0,300 % fällig am 04.11.2050		100	53	0,02
0,400 % fällig am 04.02.2037		800	611	0,21
2,625 % fällig am 04.02.2048		600	592	0,20
2,750 % fällig am 04.02.2033		600	640	0,22
Internationale Bank für Wiederaufbau und Entwicklung				
2,125 % fällig am 03.03.2025	$	1.000	953	0,33
International Development Association				
0,750 % fällig am 21.09.2028	£	1.450	1.468	0,51
Summe Supranational			20.640	7,13
SCHWEDEN				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Castellum AB				
0,750 % fällig am 04.09.2026	€	1.100	989	0,34
EQT AB				
0,875 % fällig am 14.05.2031		1.200	934	0,32
Skandinaviska Enskilda Banken AB				
4,000 % fällig am 09.11.2026		300	323	0,11
			2.246	0,77
STAATSEMISSIONEN				
Kommuninvest Sverige AB				
3,375 % fällig am 15.03.2027		200	219	0,08
Svensk Exportkredit AB				
2,000 % fällig am 30.06.2027		1.100	1.135	0,39
			1.354	0,47
Summe Schweden			3.600	1,24
GROSSBRITANNIEN				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Assura Financing PLC				
1,625 % fällig am 30.06.2033	£	1.100	918	0,32
Berkeley Group PLC				
2,500 % fällig am 11.08.2031		1.300	1.081	0,37
British Land Co. PLC				
2,375 % fällig am 14.09.2029		1.400	1.359	0,47
Burberry Group PLC				
1,125 % fällig am 21.09.2025		600	677	0,23
Cadent Finance PLC				
4,250 % fällig am 05.07.2029 (a)	€	100	109	0,04
Chanel Ceres PLC				
1,000 % fällig am 31.07.2031		2.200	1.917	0,66
Compass Group PLC				
4,375 % fällig am 08.09.2032	£	1.900	2.221	0,77

BESCHREIBUNG		PAR (000S)		MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
Derwent London PLC					
1,875 % fällig am 17.11.2031	£	1.200	$	1.058	0,37
ENW Finance PLC					
4,893 % fällig am 24.11.2032		400		469	0,16
Grainger PLC					
3,375 % fällig am 24.04.2028		700		736	0,25
Land Securities Capital Markets PLC					
4,875 % fällig am 15.09.2034		500		603	0,21
Lendlease Europe Finance Plc					
3,500 % fällig am 02.12.2033		327		272	0,09
London & Quadrant Housing Trust					
2,000 % fällig am 31.03.2032		400		377	0,13
Marks & Spencer PLC					
4,500 % fällig am 10.07.2027		300		338	0,12
National Grid PLC					
3,875 % fällig am 16.01.2029	€	300		325	0,11
NatWest Group PLC					
2,057 % fällig am 09.11.2028	£	1.200		1.244	0,43
Santander UK Group Holdings PLC					
2,896 % fällig am 15.03.2032	$	2.400		1.942	0,67
Severn Trent Utilities Finance PLC					
2,625 % fällig am 22.02.2033	£	600		577	0,20
South Eastern Power Networks PLC					
1,750 % fällig am 30.09.2034		2.100		1.801	0,62
Standard Chartered PLC					
0,800 % fällig am 17.11.2029	€	1.800		1.606	0,56
Travis Perkins PLC					
3,750 % fällig am 17.02.2026	£	1.100		1.258	0,43
Vodafone Group PLC					
5,125 % fällig am 04.06.2081	$	950		691	0,24
Workspace Group PLC					
2,250 % fällig am 11.03.2028	£	400		373	0,13
Zenith Finco PLC					
6,500 % fällig am 30.06.2027		700		679	0,23
				22.631	7,81
STAATSEMISSIONEN					
United Kingdom Gilt					
0,875 % fällig am 31.07.2033		3.700		3.372	1,17
3,750 % fällig am 22.10.2053		800		905	0,31
				4.277	1,48
Summe Großbritannien				26.908	9,29
USA					
FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE					
GoodLeap Sustainable Home Solutions Trust					
2,100 % fällig am 20.05.2048	$	1.015		781	0,27
4,000 % fällig am 20.04.2049		1.008		884	0,30
4,950 % fällig am 20.07.2049		1.887		1.736	0,60
5,520 % fällig am 22.02.2055		677		646	0,22
Loanpal Solar Loan Ltd.					
2,220 % fällig am 20.03.2048		584		425	0,15
				4.472	1,54
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL					
AES Corp.					
5,450 % fällig am 01.06.2028		700		688	0,24
Alexandria Real Estate Equities, Inc.					
2,000 % fällig am 18.05.2032		1.600		1.210	0,42
Amgen, Inc.					
3,000 % fällig am 22.02.2029		1.300		1.175	0,41
Autodesk, Inc.					
2,400 % fällig am 15.12.2031		1.000		819	0,28

BESCHREIBUNG		PAR (000S)		MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
Bank of America Corp.					
2,456 % fällig am 22.10.2025	$	100	$	95	0,03
4,134 % fällig am 12.06.2028	€	1.400		1.514	0,52
6,204 % fällig am 10.11.2028	$	500		514	0,18
Boston Properties LP					
2,450 % fällig am 01.10.2033		1.020		736	0,25
6,500 % fällig am 15.01.2034		150		151	0,05
CBRE Services, Inc.					
2,500 % fällig am 01.04.2031		1.370		1.103	0,38
CenterPoint Energy Houston Electric LLC					
5,300 % fällig am 01.04.2053		600		614	0,21
Community Preservation Corp.					
2,867 % fällig am 01.02.2030		360		302	0,10
Continental Wind LLC					
6,000 % fällig am 28.02.2033		535		541	0,19
Crown Cork & Seal Co., Inc.					
7,375 % fällig am 15.12.2026		725		750	0,26
Entergy Louisiana LLC					
4,750 % fällig am 15.09.2052		300		276	0,10
Farmers Exchange Capital					
5,454 % fällig am 15.10.2054		30		26	0,01
Ford Motor Co.					
3,250 % fällig am 12.02.2032		200		157	0,05
6,100 % fällig am 19.08.2032		434		421	0,15
Ford Motor Credit Co. LLC					
6,800 % fällig am 12.05.2028		800		802	0,28
Gap, Inc.					
3,625 % fällig am 01.10.2029		1.250		885	0,31
Georgia Power Co.					
3,250 % fällig am 15.03.2051		800		565	0,19
HAT Holdings LLC					
6,000 % fällig am 15.04.2025		500		494	0,17
Host Hotels & Resorts LP					
2,900 % fällig am 15.12.2031		700		551	0,19
3,375 % fällig am 15.12.2029		600		513	0,18
3,500 % fällig am 15.09.2030		2.075		1.760	0,61
Hudson Pacific Properties LP					
3,950 % fällig am 01.11.2027		1.000		728	0,25
5,950 % fällig am 15.02.2028		800		637	0,22
Hyundai Capital America					
5,800 % fällig am 26.06.2025		2.200		2.197	0,76
Kilroy Realty LP					
2,500 % fällig am 15.11.2032		700		487	0,17
2,650 % fällig am 15.11.2033		100		68	0,02
MidAmerican Energy Co.					
2,700 % fällig am 01.08.2052		950		602	0,21
3,650 % fällig am 01.08.2048		750		579	0,20
4,250 % fällig am 15.07.2049		400		341	0,12
Mississippi Power Co.					
3,100 % fällig am 30.07.2051		900		607	0,21
Moody's Corp.					
2,000 % fällig am 19.08.2031		300		242	0,08
3,100 % fällig am 29.11.2061		840		554	0,19
MSCI, Inc.					
3,250 % fällig am 15.08.2033		200		161	0,06
4,000 % fällig am 15.11.2029		100		91	0,03
New York State Electric & Gas Corp.					
2,150 % fällig am 01.10.2031		1.100		862	0,30
NextEra Energy Capital Holdings, Inc.					
1,900 % fällig am 15.06.2028		2.100		1.802	0,62
Niagara Mohawk Power Corp.					
5,783 % fällig am 16.09.2052		620		623	0,21
Northern States Power Co.					
2,250 % fällig am 01.04.2031		600		502	0,17
2,600 % fällig am 01.06.2051		200		128	0,04

BESCHREIBUNG		PAR (000S)		MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
NSTAR Electric Co.					
3,100 % fällig am 01.06.2051	$	1.070	$	752	0,26
4,950 % fällig am 15.09.2052		300		292	0,10
Oberlin College					
2,874 % fällig am 01.10.2051		1.800		1.206	0,42
Pacific Gas & Electric Co.					
6,700 % fällig am 01.04.2053		400		393	0,14
PacifiCorp					
2,900 % fällig am 15.06.2052		600		375	0,13
PNC Financial Services Group, Inc.					
4,758 % fällig am 26.01.2027		2.000		1.956	0,68
Public Service Co. of Colorado					
2,700 % fällig am 15.01.2051		75		48	0,02
3,200 % fällig am 01.03.2050		425		301	0,10
Public Service Electric & Gas Co.					
4,650 % fällig am 15.03.2033		1.100		1.080	0,37
Puget Sound Energy, Inc.					
5,448 % fällig am 01.06.2053		540		544	0,19
Solar Star Funding LLC					
5,375 % fällig am 30.06.2035		156		153	0,05
Southern California Edison Co.					
2,500 % fällig am 01.06.2031		1.000		832	0,29
Southwestern Public Service Co.					
3,150 % fällig am 01.05.2050		450		314	0,11
3,750 % fällig am 15.06.2049		400		307	0,11
TerraForm Power Operating LLC					
5,000 % fällig am 31.01.2028		1.650		1.521	0,53
Topaz Solar Farms LLC					
5,750 % fällig am 30.09.2039		794		780	0,27
UDR, Inc.					
1,900 % fällig am 15.03.2033		900		659	0,23
3,100 % fällig am 01.11.2034		150		120	0,04
Verizon Communications, Inc.					
1,500 % fällig am 18.09.2030		4.110		3.250	1,12
5,050 % fällig am 09.05.2033		500		495	0,17
Wisconsin Electric Power Co.					
4,750 % fällig am 30.09.2032		500		490	0,17
Wisconsin Power & Light Co.					
4,950 % fällig am 01.04.2033		600		594	0,20
Wisconsin Public Service Corp.					
2,850 % fällig am 01.12.2051		450		297	0,10
				44.632	15,42
KOMMUNALANLEIHEN UND WECHSEL					
New York Water & Sewer System Revenue Bonds, (BABs), Series 2010					
5,724 % fällig am 15.06.2042		170		188	0,07
New York Water & Sewer System Revenue Bonds, Series 2010					
5,882 % fällig am 15.06.2044		110		124	0,04
San Francisco, California Public Utilities Commission Water Revenue Bonds, Series 2020					
1,988 % fällig am 01.11.2031		255		208	0,07
2,825 % fällig am 01.11.2041		145		113	0,04
State Board of Administration Finance Corp., Florida Revenue Notes, Series 2020					
2,154 % fällig am 01.07.2030		170		142	0,05
				775	0,27
Summe USA				49.879	17,23
JUNGFERNINSELN (BRITISCH)					
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL					
Star Energy Geothermal Wayang Windu Ltd.					
6,750 % fällig am 24.04.2033		811		797	0,27
Summe Übertragbare Wertpapiere			**$**	**249.473**	**86,16**

PENSIONSGESCHÄFTE

Kontrahent	Kredit-zins	Abrechnungs-datum	Fälligkeits-datum	Kapital-betrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensions-geschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensions-geschäft[1]	% des Nettovermögens
BOS	5,140 %	30.06.2023	03.07.2023	$ 3.200	U.S. Treasury Bonds 4,750 % fällig am 15.02.2041	$ (3.287)	$ 3.200	$ 3.201	1,11
	5,170	30.06.2023	03.07.2023	30.800	U.S. Treasury Bonds 3,250 % fällig am 15.02.2042	(31.708)	30.800	30.813	10,63
Summe Pensionsgeschäfte						**$ (34.995)**	**$ 34.000**	**$ 34.014**	**11,74**

[1] Umfasst aufgelaufene Zinsen.

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

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

FUTURES

Beschreibung	Art	Ablauf-monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Euro-Bobl September Futures	Short	09.2023	75	$ 15	0,01
Euro-Bund 10-Year Bond September Futures	Short	09.2023	206	271	0,09
Euro-Buxl 30-Year Bond September Futures	Short	09.2023	22	(46)	(0,02)
Japan Government 10-Year Bond September Futures	Short	09.2023	2	(7)	0,00
U.S. Treasury 2-Year Note September Futures	Short	09.2023	16	49	0,02
U.S. Treasury 5-Year Note September Futures	Long	09.2023	741	(1.223)	(0,42)
U.S. Treasury 10-Year Note September Futures	Long	09.2023	186	(351)	(0,12)
U.S. Treasury 10-Year Ultra September Futures	Long	09.2023	40	(42)	(0,01)
U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond September Futures	Short	09.2023	55	(108)	(0,04)
United Kingdom Long Gilt September Futures	Short	09.2023	68	73	0,02
				$ (1.369)	(0,47)
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate				**$ (1.369)**	**(0,47)**

ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)

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

ZINSSWAPS

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Erhalt[1]	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	3,250 %	20.09.2053	£ 700	$ 61	0,02
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	0,000	08.07.2023	$ 100	(1)	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,750	15.06.2027	3.200	(165)	(0,05)
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,840	08.07.2051	100	31	0,01
Erhalt[1]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,943	15.06.2051	400	112	0,04
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	1,000	16.06.2026	CAD 900	(57)	(0,02)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	0,000	08.07.2023	$ 100	1	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,943	15.09.2023	400	4	0,00
Erhalt[1]	6-Month EUR-EURIBOR	2,500	20.09.2053	€ 1.800	(22)	(0,01)
Zahlung[1]	6-Month EUR-EURIBOR	3,000	20.09.2028	4.900	(59)	(0,02)
					$ (95)	(0,03)
Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate					**$ (95)**	**(0,03)**

[1] Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft.

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

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

DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung		Zu erhaltende Währung		Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	08.2023	€	459	$	499	$ 0	$ (3)	$ (3)	0,00
	08.2023	$	189	AUD	279	0	(3)	(3)	0,00
	08.2023		355	€	331	7	0	7	0,00
	08.2023		339	¥	46.900	0	(13)	(13)	0,00
BPS	08.2023	€	1.560	$	1.695	1	(11)	(10)	0,00
	08.2023	$	4.369	€	4.051	60	0	60	0,02
BRC	08.2023	£	917	$	1.150	0	(15)	(15)	(0,01)
	08.2023	$	644	£	521	18	0	18	0,01
CBK	08.2023	CAD	6.658	$	4.993	0	(42)	(42)	(0,01)
	08.2023	€	3.753		4.067	2	(38)	(36)	(0,01)
	08.2023	£	1.944		2.424	0	(48)	(48)	(0,02)
	08.2023	SEK	987		97	6	0	6	0,00
	08.2023	$	1.488	€	1.379	19	0	19	0,01
	08.2023		488	£	394	13	0	13	0,00
JPM	08.2023	€	18.161	$	20.004	149	0	149	0,05
	08.2023	£	9.768		12.371	0	(50)	(50)	(0,02)
	08.2023	$	394	£	317	9	0	9	0,00
MBC	08.2023	€	106.662	$	117.699	1.089	0	1.089	0,38
MYI	07.2023		5		6	0	0	0	0,00
	07.2023	£	45		57	0	0	0	0,00
	07.2023	$	2.587	£	2.050	20	0	20	0,01
	08.2023	¥	5.053	$	38	3	0	3	0,00
RBC	08.2023	£	1.895		2.394	0	(16)	(16)	(0,01)
SCX	08.2023	$	915	¥	126.800	0	(32)	(32)	(0,01)
UAG	08.2023	£	8.556	$	10.814	0	(65)	(65)	(0,02)
						$ 1.396	$ (336)	$ 1.060	0,37

ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklasse Institutional AUD (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung		Zu erhaltende Währung		Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
CBK	07.2023	$	82	AUD	126	$ 2	$ 0	$ 2	0,00
GLM	07.2023		82		126	2	0	2	0,00
MBC	07.2023		60		92	1	0	1	0,00
SCX	07.2023	AUD	37	$	25	0	0	0	0,00
	07.2023	$	21	AUD	32	1	0	1	0,00
	08.2023		25		37	0	0	0	0,00
						$ 6	$ 0	$ 6	0,00

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklasse Institutional CHF (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung		Zu erhaltende Währung		Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BPS	07.2023	CHF	236	$	264	$ 0	$ 0	$ 0	0,00
	07.2023	$	356	CHF	322	4	0	4	0,00
	08.2023		264		235	0	0	0	0,00
MYI	07.2023	CHF	9	$	9	0	0	0	0,00
SCX	07.2023	$	254	CHF	228	1	0	1	0,00
UAG	07.2023	CHF	244	$	272	0	(1)	(1)	0,00
	07.2023	$	229	CHF	206	1	0	1	0,00
	08.2023		272		243	1	0	1	0,00
						$ 7	$ (1)	$ 6	0,00

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklassen Institutional EUR (Hedged) thesaurierend, Institutional EUR (Hedged) ausschüttend und Class E EUR (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung		Zu erhaltende Währung		Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2023	€	107	$	116	$ 0	$ (1)	$ (1)	0,00
	07.2023	$	60.540	€	56.331	917	0	917	0,32
BPS	07.2023	€	54.998	$	60.260	257	0	257	0,09
	07.2023	$	59.968	€	55.775	882	0	882	0,30
	08.2023		59.780		54.482	0	(258)	(258)	(0,09)
CBK	07.2023	€	55.738	$	60.581	0	(228)	(228)	(0,08)
	07.2023	$	1.325	€	1.212	1	(4)	(3)	0,00
	08.2023		59.272		54.441	205	0	205	0,07
JPM	07.2023	€	54.441	$	59.444	49	0	49	0,02
	07.2023	$	4.803	€	4.492	98	0	98	0,03
	08.2023		59.527		54.441	0	(51)	(51)	(0,02)
MBC	07.2023	€	76	$	81	0	(2)	(2)	0,00
	07.2023	$	2.989	€	2.784	49	(1)	48	0,02
MYI	07.2023	€	9.635	$	10.455	0	(57)	(57)	(0,02)
SOG	07.2023	$	59.362	€	55.183	842	0	842	0,29
						$ 3.300	$ (602)	$ 2.698	0,93

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklassen Institutional GBP (Hedged) thesaurierend und Institutional GBP (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung		Zu erhaltende Währung		Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2023	$	46	£	37	$ 1	$ 0	$ 1	0,00
BPS	07.2023	£	11	$	14	0	0	0	0,00
	07.2023	$	26.260	£	21.231	732	0	732	0,25
BRC	07.2023	£	216	$	275	0	0	0	0,00
	07.2023	$	60	£	48	1	0	1	0,00
CBK	07.2023	£	124	$	157	0	0	0	0,00
	07.2023	$	510	£	402	2	0	2	0,00
JPM	07.2023	£	21.830	$	27.602	0	(152)	(152)	(0,05)
	08.2023	$	27.607	£	21.830	152	0	152	0,05
MBC	07.2023	£	55	$	70	0	0	0	0,00
	07.2023	$	26.334	£	21.272	710	0	710	0,25
MYI	07.2023	£	694	$	861	0	(22)	(22)	(0,01)
	07.2023	$	26.061	£	20.968	597	0	597	0,21
RBC	07.2023		3.947		3.102	0	(3)	(3)	0,00
SCX	07.2023	£	256	$	318	0	(7)	(7)	0,00
						$ 2.195	$ (184)	$ 2.011	0,70

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklassen Institutional SEK (Hedged) thesaurierend und Administrative SEK (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung		Zu erhaltende Währung		Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
AZD	07.2023	SEK	25.919	$	2.402	$ 2	$ 0	$ 2	0,00
BOA	07.2023		25.914		2.406	7	0	7	0,00
	07.2023	$	1.802	SEK	19.513	5	0	5	0,00
	08.2023		532		5.733	0	0	0	0,00
BRC	07.2023	SEK	25.872	$	2.422	27	0	27	0,01
	07.2023	$	34	SEK	366	0	0	0	0,00
CBK	07.2023	SEK	20.143	$	1.871	6	0	6	0,00
	07.2023	$	5.554	SEK	60.664	62	0	62	0,02
GLM	07.2023	SEK	25.876	$	2.422	26	0	26	0,01
MBC	07.2023		25		2	0	0	0	0,00
	07.2023	$	4.675	SEK	50.344	0	(14)	(14)	0,00
SCX	07.2023	SEK	20.305	$	1.886	6	0	6	0,00
	07.2023	$	4.685	SEK	50.679	6	0	6	0,00
UAG	07.2023	SEK	25.919	$	2.390	0	(10)	(10)	0,00
						$ 147	$ (24)	$ 123	0,04

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklasse Institutional SGD (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung		Zu erhaltende Währung		Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BRC	07.2023	$	1.372	SGD	1.857	$ 0	$ 0	$ 0	0,00
GLM	07.2023	SGD	97	$	72	1	0	1	0,00
	07.2023	$	25	SGD	34	0	0	0	0,00
MBC	07.2023		1.251		1.690	0	(2)	(2)	0,00
	08.2023	SGD	75	$	55	0	0	0	0,00
MYI	07.2023		1.760		1.302	2	0	2	0,00
	08.2023	$	1.302	SGD	1.758	0	(2)	(2)	0,00
SCX	07.2023		198		268	0	0	0	0,00
UAG	07.2023	SGD	20	$	15	0	0	0	0,00
	07.2023	$	1.348	SGD	1.824	0	(1)	(1)	0,00
						$ 3	$ (5)	$ (2)	0,00

Summe Freiverkehrsfinanzderivate	**$ 5.902**	**2,04**
Summe Anlagen	**$ 287.911**	**99,44**
Sonstige Aktiva und Passiva	**$ 1.613**	**0,56**
Nettovermögen	**$ 289.524**	**100,00**

ERLÄUTERUNGEN ZUR AUFSTELLUNG DES WERTPAPIERBESTANDS (Angaben in Tausend*):

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

(a) **Wertpapier per Emissionstermin.**

(b) **Nullkuponwertpapier.**

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

(d) **Bedingt wandelbares Wertpapier.**

(e) **Eingeschränkte Wertpapiere (31. Dezember 2022: null):**

Emittentenbeschreibung	Kupon	Fälligkeits-datum	Kauf-datum	Kosten	Markt-wert	% des Nettovermögens
Brookfield Property Finance ULC	7,125 %	13.02.2028	09.02.2023	$ 522	$ 490	0,17

Barmittel in Höhe von 3.962 USD (31. Dezember 2022: 3.781 USD) wurden zum 30. Juni 2023 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Barmittel in Höhe von null USD (31. Dezember 2022: 4.260 USD) wurden zum 30. Juni 2023 gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. als Sicherheit für Finanzderivate verpfändet.

Beizulegender Zeitwert[1]

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 30. Juni 2023 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie[2]	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	$ 0	$ 249.473	$ 0	$ 249.473
Pensionsgeschäfte	0	34.000	0	34.000
Finanzderivate[3]	306	4.132	0	4.438
Summen	**$ 306**	**$ 287.605**	**$ 0**	**$ 287.911**

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

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

(1) Siehe Erläuterung 3 in den Erläuterungen zum Abschluss für weitere Informationen.

(2) Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung des Wertpapierbestands.

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

Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC-Finanzderivate und -Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2023 und 31. Dezember 2022:

	Zum 30. Jun. 2023			Zum 31. Dez. 2022		
Kontrahent	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-engagement[1]	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-engagement[1]
AZD	$ 2	$ 0	$ 2	$ k. A.	$ k. A.	$ k. A.
BOA	917	(700)	217	(522)	560	38
BPS	1.667	(1.540)	127	(3.021)	2.670	(351)
BRC	31	(20)	11	(6)	40	34
CBK	(42)	0	(42)	1.594	(1.510)	84
DUB	k. A.	k. A.	k. A.	(1.016)	990	(26)
GLM	29	0	29	42	(110)	(68)
JPM	204	(350)	(146)	16	0	16
MBC	1.830	(1.800)	30	1.318	(1.270)	48
MYI	541	(350)	191	43	(20)	23
RBC	(19)	0	(19)	0	0	0
RYL	k. A.	k. A.	k. A.	(113)	0	(113)
SCX	(25)	0	(25)	1.674	(1.560)	114
SOG	842	(630)	212	k. A.	k. A.	k. A.
UAG	(75)	0	(75)	86	0	86

(1) Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären.

Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung des Wertpapierbestands zum 30. Juni 2023:

	30. Jun. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	76,41	73,76
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	9,75	11,04
Sonstige übertragbare Wertpapiere	k. A.	0,04
Pensionsgeschäfte	11,74	12,57
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	(0,47)	0,81
Zentral abgerechnete Finanzderivate	(0,03)	0,06
Freiverkehrsfinanzderivate	2,04	0,03

Das Anlageportfolio des Fonds konzentriert sich zum 30. Juni 2023 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	30. Jun. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
Australien	0,31	0,31
Österreich	0,44	0,21
Belgien	0,43	0,40
Brasilien	k. A.	0,07
Kanada	1,73	1,62
Chile	0,73	0,70
Zypern	0,30	0,28
Tschechische Republik	0,22	k. A.
Dänemark	1,12	k. A.
Finnland	1,22	0,28
Frankreich	6,47	6,29
Deutschland	12,63	11,61
Hongkong	0,27	k. A.
Indien	1,11	1,30
Irland	2,18	1,49
Italien	1,69	1,97
Japan	3,55	3,29
Jersey, Kanalinseln	0,38	0,36
Luxemburg	3,01	2,89
Mauritius	0,12	0,97
Mexiko	0,31	0,29
Multinational	0,54	0,87
Niederlande	8,30	8,65
Norwegen	0,63	k. A.
Singapur	0,20	0,20

Anlagen zum Marktwert	30. Jun. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
Südkorea	0,56	0,31
Spanien	2,55	2,01
Supranational	7,13	4,97
Schweden	1,24	1,20
Schweiz	k. A.	0,30
Großbritannien	9,29	8,79
USA	17,23	21,97
Jungferninseln (Britisch)	0,27	0,26
Kurzfristige Instrumente	k. A.	0,98
Pensionsgeschäfte	11,74	12,57
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	(0,47)	0,81
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Zinsswaps	(0,03)	0,06
Freiverkehrsfinanzderivate		
Devisenterminkontrakte	0,37	(1,53)
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	1,67	1,56
Sonstige Aktiva und Passiva	0,56	1,69
Nettovermögen	100,00	100,00

BESCHREIBUNG		PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE				
AUSTRALIEN				
STAATSEMISSIONEN				
Australia Government International Bond				
0,250 % fällig am 21.11.2032	AUD	5.495	$ 3.207	0,33
0,750 % fällig am 21.11.2027		4.186	2.706	0,28
3,000 % fällig am 20.09.2025		1.726	1.185	0,12
Summe Australien			7.098	0,73
KANADA				
STAATSEMISSIONEN				
Canadian Government Real Return Bond				
0,500 % fällig am 01.12.2050 (a)	CAD	241	145	0,01
4,250 % fällig am 01.12.2026 (a)		2.849	2.320	0,24
Summe Kanada			2.465	0,25
CAYMAN INSELN				
FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE				
Allegro CLO Ltd.				
6,425 % fällig am 16.10.2031	$	500	495	0,05
Atlas Senior Loan Fund Ltd.				
6,350 % fällig am 15.01.2031		6.063	5.985	0,62
6,410 % fällig am 16.01.2030		938	933	0,10
BlueMountain CLO Ltd.				
6,453 % fällig am 22.10.2030		1.705	1.697	0,17
Carlyle Global Market Strategies CLO Ltd.				
6,260 % fällig am 15.01.2031		584	579	0,06
Catamaran CLO Ltd.				
6,373 % fällig am 22.04.2030		2.470	2.455	0,25
Cedar Funding CLO Ltd.				
6,360 % fällig am 17.07.2031		700	694	0,07
CIFC Funding Ltd.				
6,352 % fällig am 27.04.2031		1.200	1.190	0,12
Dryden CLO Ltd.				
6,331 % fällig am 15.05.2031		700	694	0,07
Greystone Commercial Real Estate Notes Ltd.				
6,373 % fällig am 15.09.2037		1.623	1.601	0,16
ICG U.S. CLO Ltd.				
6,353 % fällig am 22.07.2031		2.500	2.472	0,25
LCM LP				
6,290 % fällig am 20.07.2031		3.300	3.268	0,34
6,390 % fällig am 15.10.2031		1.200	1.185	0,12
Madison Park Funding Ltd.				
0,000 % fällig am 29.07.2030		395	394	0,04
6,103 % fällig am 22.04.2027		273	271	0,03
Magnetite Ltd.				
6,240 % fällig am 15.04.2031		295	293	0,03
Octagon Investment Partners Ltd.				
6,220 % fällig am 16.04.2031		3.500	3.466	0,36
Octagon Loan Funding Ltd.				
6,525 % fällig am 18.11.2031		2.500	2.477	0,26
OZLM Ltd.				
6,340 % fällig am 17.04.2031		2.759	2.721	0,28
6,400 % fällig am 20.01.2031		3.243	3.212	0,33
Regatta Funding Ltd.				
6,510 % fällig am 17.10.2030		3.879	3.862	0,40
Sound Point CLO Ltd.				
6,368 % fällig am 26.07.2031		1.500	1.474	0,15
6,370 % fällig am 21.01.2031		1.373	1.351	0,14
6,412 % fällig am 18.04.2031		2.200	2.162	0,22
TIAA CLO Ltd.				
6,450 % fällig am 20.07.2031		500	494	0,05
Voya CLO Ltd.				
6,351 % fällig am 14.07.2031		495	490	0,05
6,458 % fällig am 15.10.2030		1.829	1.823	0,19
			47.738	4,91
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Avolon Holdings Funding Ltd.				
2,528 % fällig am 18.11.2027		258	218	0,02
Summe Cayman Inseln			47.956	4,93

BESCHREIBUNG		PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
DÄNEMARK				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Jyske Realkredit A/S				
1,000 % fällig am 01.10.2050	DKK	552	$ 58	0,01
1,000 % fällig am 01.10.2053		6.301	612	0,06
1,500 % fällig am 01.10.2053		6.938	753	0,08
2,000 % fällig am 01.10.2053		2.778	317	0,03
2,500 % fällig am 01.10.2047		1	0	0,00
Nordea Kredit Realkreditaktieselskab				
0,500 % fällig am 01.10.2043		6.645	737	0,08
1,000 % fällig am 01.10.2050		0	0	0,00
1,500 % fällig am 01.10.2053		3.900	397	0,04
2,000 % fällig am 01.10.2053		999	114	0,01
2,500 % fällig am 01.10.2047		3	0	0,00
Nykredit Realkredit A/S				
1,000 % fällig am 01.10.2050		30.724	3.233	0,33
1,000 % fällig am 01.10.2053		10	1	0,00
1,500 % fällig am 01.10.2053		85.897	8.950	0,92
2,000 % fällig am 01.10.2053		6.073	668	0,07
2,500 % fällig am 01.10.2047		13	2	0,00
3,500 % fällig am 01.10.2053		14.485	1.939	0,20
Realkredit Danmark A/S				
1,000 % fällig am 01.10.2050		13.858	1.460	0,15
1,000 % fällig am 01.10.2053		5.251	522	0,05
1,500 % fällig am 01.10.2053		17.747	1.913	0,20
2,000 % fällig am 01.10.2053		3.919	425	0,04
2,500 % fällig am 01.04.2047		12	2	0,00
			22.103	2,27
STAATSEMISSIONEN				
Denmark Government International Bond				
0,100 % fällig am 15.11.2023 (a)		13.470	1.976	0,21
Summe Dänemark			24.079	2,48
FRANKREICH				
STAATSEMISSIONEN				
France Government International Bond				
0,100 % fällig am 01.03.2025 (a)	€	19.962	21.387	2,20
0,100 % fällig am 25.07.2031 (a)		9.707	10.297	1,06
0,100 % fällig am 25.07.2038 (a)		7.005	7.119	0,73
2,100 % fällig am 25.07.2023 (a)		34.194	37.264	3,83
Summe Frankreich			76.067	7,82
IRLAND				
FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE				
Ares European CLO				
3,837 % fällig am 15.10.2030		1.391	1.489	0,15
Ares European CLO DAC				
3,787 % fällig am 15.04.2030		688	737	0,08
4,050 % fällig am 20.04.2032		2.100	2.248	0,23
Armada Euro CLO DAC				
3,897 % fällig am 15.07.2031		500	533	0,06
Bain Capital Euro CLO DAC				
4,311 % fällig am 24.01.2033		1.300	1.391	0,14
Black Diamond CLO DAC				
4,060 % fällig am 20.01.2032		1.966	2.115	0,22
4,303 % fällig am 15.05.2032		2.600	2.775	0,29
BlueMountain Fuji EUR CLO DAC				
1,050 % fällig am 15.01.2031		994	1.000	0,10
3,897 % fällig am 15.01.2031		2.088	2.232	0,23
BNPP AM Euro CLO DAC				
3,777 % fällig am 15.04.2031		1.600	1.707	0,18
Cairn CLO DAC				
3,957 % fällig am 15.10.2031		2.300	2.460	0,25
4,212 % fällig am 20.10.2028		8	9	0,00
Carlyle Euro CLO DAC				
3,877 % fällig am 15.01.2031		2.190	2.339	0,24
4,213 % fällig am 15.08.2032		900	960	0,10
CVC Cordatus Loan Fund DAC				
4,305 % fällig am 26.08.2032		500	534	0,06
Dryden Euro CLO DAC				
4,073 % fällig am 15.05.2032		1.285	1.366	0,14
4,183 % fällig am 15.05.2034		2.400	2.562	0,26
Harvest CLO DAC				
1,040 % fällig am 15.07.2031		700	696	0,07
3,937 % fällig am 15.07.2031		1.400	1.491	0,15
4,250 % fällig am 26.06.2030		1.418	1.516	0,16

BESCHREIBUNG		PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
Invesco Euro CLO DAC				
4,097 % fällig am 15.07.2032	€	2.600	$ 2.768	0,28
Jubilee CLO DAC				
4,326 % fällig am 15.12.2029		931	1.004	0,10
Laurelin DAC				
3,920 % fällig am 20.10.2031		1.200	1.286	0,13
Madison Park Euro Funding DAC				
3,977 % fällig am 15.07.2032		700	745	0,08
Man GLG Euro CLO DAC				
4,047 % fällig am 15.01.2030		110	118	0,01
Oak Hill European Credit Partners DAC				
3,940 % fällig am 20.10.2031		1.100	1.169	0,12
OCP Euro CLO DAC				
4,091 % fällig am 22.09.2034		2.600	2.763	0,28
Palmer Square European Loan Funding DAC				
3,897 % fällig am 15.10.2031		844	903	0,09
Rockford Tower Europe CLO DAC				
4,577 % fällig am 20.12.2031		2.518	2.696	0,28
Segovia European CLO DAC				
4,080 % fällig am 20.07.2032		2.300	2.445	0,25
Tikehau CLO DAC				
4,144 % fällig am 04.08.2034		2.600	2.772	0,29
Toro European CLO DAC				
4,133 % fällig am 15.02.2034		3.700	3.929	0,40
			52.758	5,42
NON-AGENCY-MBS				
European Loan Conduit DAC				
4,358 % fällig am 17.02.2030		573	613	0,06
Summe Irland			53.371	5,48
ITALIEN				
STAATSEMISSIONEN				
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro				
0,400 % fällig am 15.05.2030 (a)		18.499	18.462	1,90
1,400 % fällig am 26.05.2025 (a)		33.783	36.495	3,75
2,350 % fällig am 15.09.2024 (a)		26.289	28.868	2,97
2,550 % fällig am 15.09.2041 (a)		1.464	1.766	0,18
2,600 % fällig am 15.09.2023 (a)		11.890	12.969	1,33
Summe Italien			98.560	10,13
JAPAN				
STAATSEMISSIONEN				
Japan Government International Bond				
0,005 % fällig am 10.03.2031 (a)	¥	348.863	2.589	0,27
0,100 % fällig am 10.09.2024 (a)		938.960	6.678	0,69
0,100 % fällig am 10.03.2025 (a)		1.020.895	7.293	0,75
0,100 % fällig am 10.03.2026 (a)		773.102	5.603	0,57
0,100 % fällig am 10.03.2028 (a)		1.337.314	9.752	1,00
0,100 % fällig am 10.03.2029 (a)		4.239.309	31.047	3,19
Summe Japan			62.962	6,47
NEUSEELAND				
STAATSEMISSIONEN				
New Zealand Government International Bond				
2,000 % fällig am 20.09.2025	NZD	3.147	1.925	0,20
PERU				
STAATSEMISSIONEN				
Peru Government International Bond				
5,940 % fällig am 12.02.2029	PEN	400	108	0,01
SPANIEN				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A.				
5,875 % fällig am 24.09.2023 (c)(d)	€	400	433	0,04
STAATSEMISSIONEN				
Spain Government International Bond				
0,150 % fällig am 30.11.2023 (a)		16.725	18.128	1,86
0,500 % fällig am 30.04.2030		2.500	2.279	0,24

BESCHREIBUNG		PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
0,650 % fällig am 30.11.2027 (a)	€	26.866	$ 28.789	2,96
0,700 % fällig am 30.11.2033 (a)		1.324	1.382	0,14
			50.578	5,20
Summe Spanien			51.011	5,24
SCHWEDEN				
STAATSEMISSIONEN				
Sweden Government International Bond				
0,125 % fällig am 01.06.2026	SEK	3.059	275	0,03
0,125 % fällig am 01.12.2027		15.965	1.428	0,15
1,000 % fällig am 01.06.2025		124.211	11.427	1,17
Summe Schweden			13.130	1,35
SCHWEIZ				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
UBS Group AG				
2,593 % fällig am 11.09.2025	$	600	572	0,06
4,177 % fällig am 16.01.2026	€	400	430	0,04
Summe Schweiz			1.002	0,10
GROSSBRITANNIEN				
NON-AGENCY-MBS				
Great Hall Mortgages PLC				
5,152 % fällig am 18.03.2039	£	6	8	0,00
5,172 % fällig am 18.06.2038		6	7	0,00
Polaris PLC				
5,640 % fällig am 23.10.2059		3.456	4.363	0,45
Towd Point Mortgage Funding PLC				
5,635 % fällig am 20.10.2051		835	1.063	0,11
			5.441	0,56
		AKTIEN		
VORZUGSWERTPAPIERE				
Nationwide Building Society				
10,250 %		1.606	235	0,02
		PAR (000S)		
STAATSEMISSIONEN				
United Kingdom Gilt				
0,125 % fällig am 22.03.2024 (a)	£	17.538	21.868	2,25
0,125 % fällig am 22.03.2026 (a)		175	214	0,02
0,125 % fällig am 10.08.2028 (a)		4.470	5.467	0,56
0,125 % fällig am 10.08.2041 (a)		4.524	5.028	0,52
1,250 % fällig am 22.11.2027 (a)		40.705	52.277	5,37
2,500 % fällig am 17.07.2024		23.479	30.455	3,13
			115.309	11,85
Summe Großbritannien			120.985	12,43
USA				
FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE				
ACE Securities Corp. Home Equity Loan Trust				
6,200 % fällig am 25.12.2033	$	786	766	0,08
Ameriquest Mortgage Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates				
6,110 % fällig am 25.10.2035		1.300	1.164	0,12
Asset-Backed Funding Certificates Trust				
5,290 % fällig am 25.10.2036		2.300	2.100	0,22
5,750 % fällig am 25.10.2034		103	103	0,01
CIT Mortgage Loan Trust				
6,500 % fällig am 25.10.2037		54	54	0,01
Citigroup Mortgage Loan Trust				
5,440 % fällig am 25.09.2036		458	433	0,05
Citigroup Mortgage Loan Trust Asset-Backed Pass-Through Certificates				
6,095 % fällig am 25.10.2034		291	275	0,03
Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.				
5,840 % fällig am 25.10.2035 ^		800	716	0,07
Countrywide Asset-Backed Certificates Trust				
6,110 % fällig am 25.02.2036		1.906	1.858	0,19
Ellington Loan Acquisition Trust				
6,250 % fällig am 25.05.2037		599	574	0,06
First Franklin Mortgage Loan Trust				
5,460 % fällig am 25.07.2036		150	141	0,01

BESCHREIBUNG		PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
Home Equity Asset Trust				
6,005 % fällig am 25.08.2034	$	98	$ 96	0,01
6,170 % fällig am 25.03.2035		1.465	1.383	0,14
Home Equity Mortgage Loan Asset-Backed Trust				
5,290 % fällig am 25.11.2036		661	594	0,06
Lehman XS Trust				
7,450 % fällig am 25.12.2037		826	837	0,09
Mid-State Capital Corp. Trust				
5,787 % fällig am 15.10.2040		79	77	0,01
Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust				
5,810 % fällig am 25.01.2035		331	320	0,03
6,125 % fällig am 25.07.2034		139	134	0,01
New Century Home Equity Loan Trust				
5,915 % fällig am 25.02.2035		472	431	0,04
Option One Mortgage Loan Trust				
5,690 % fällig am 25.01.2036		1.700	1.517	0,16
Renaissance Home Equity Loan Trust				
6,350 % fällig am 25.11.2034		184	152	0,02
Saxon Asset Securities Trust				
5,460 % fällig am 25.09.2037		239	226	0,02
5,585 % fällig am 25.09.2036		3.000	2.750	0,28
Securitized Asset-Backed Receivables LLC Trust				
5,870 % fällig am 25.10.2035		1.495	1.198	0,12
			17.899	1,84
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Broadcom, Inc.				
3,137 % fällig am 15.11.2035		1.459	1.119	0,12
Lehman Brothers Holdings, Inc.				
7,875 % fällig am 08.05.2018 ^	£	100	1	0,00
			1.120	0,12
KOMMUNALANLEIHEN UND WECHSEL				
American Municipal Power, Inc., Ohio Revenue Bonds, Series 2010				
7,734 % fällig am 15.02.2033	$	200	237	0,03
Bay Area Toll Authority, California Revenue Bonds, (BABs), Series 2010				
6,918 % fällig am 01.04.2040		600	708	0,07
California State General Obligation Bonds, (BABs), Series 2009				
7,300 % fällig am 01.10.2039		500	605	0,06
7,500 % fällig am 01.04.2034		100	122	0,01
7,550 % fällig am 01.04.2039		200	252	0,03
Los Angeles Department of Water & Power, California Revenue Bonds, Series 2010				
5,516 % fällig am 01.07.2027		500	511	0,05
New York City Transitional Finance Authority Future Tax Secured Revenue Bonds, (BABs), Series 2010				
5,508 % fällig am 01.08.2037		200	208	0,02
New York State Urban Development Corp. Revenue Bonds, (BABs), Series 2009				
5,770 % fällig am 15.03.2039		100	105	0,01
			2.748	0,28
NON-AGENCY-MBS				
Banc of America Funding Trust				
4,496 % fällig am 20.09.2034		7	6	0,00
BCAP LLC Trust				
5,250 % fällig am 26.04.2037		190	111	0,01
Bear Stearns Adjustable Rate Mortgage Trust				
3,553 % fällig am 25.09.2034		52	48	0,01
3,887 % fällig am 25.05.2047 ^		6	5	0,00
4,033 % fällig am 25.11.2034		4	4	0,00
4,033 % fällig am 25.01.2035		21	19	0,00
4,439 % fällig am 25.02.2034		7	6	0,00
Bear Stearns ALT-A Trust				
4,116 % fällig am 25.08.2036 ^		12	6	0,00
5,044 % fällig am 25.10.2033		7	7	0,00
Chase Mortgage Finance Trust				
4,086 % fällig am 25.03.2037 ^		4	4	0,00
Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.				
5,500 % fällig am 25.08.2034		0	0	0,00
6,430 % fällig am 25.09.2035		1	1	0,00
Countrywide Alternative Loan Trust				
3,940 % fällig am 25.02.2037 ^		6	5	0,00

BESCHREIBUNG		PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
5,367 % fällig am 20.07.2046 ^	$	8	$ 7	0,00
5,530 % fällig am 25.09.2046 ^		8	7	0,00
Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust				
3,611 % fällig am 25.09.2047 ^		5	5	0,00
5,790 % fällig am 25.03.2035		63	59	0,01
5,910 % fällig am 25.09.2034		1	1	0,00
GreenPoint Mortgage Funding Trust				
5,590 % fällig am 25.06.2045		69	65	0,01
GSR Mortgage Loan Trust				
4,070 % fällig am 25.09.2035		2	2	0,00
4,485 % fällig am 25.06.2034		4	3	0,00
4,660 % fällig am 25.07.2035		38	36	0,00
HarborView Mortgage Loan Trust				
6,057 % fällig am 20.06.2035		185	167	0,02
Impac CMB Trust				
6,050 % fällig am 25.10.2033		1	1	0,00
IndyMac Mortgage Loan Trust				
5,630 % fällig am 25.07.2035		1.280	1.201	0,12
5,790 % fällig am 25.07.2045		3	2	0,00
JPMorgan Mortgage Trust				
4,111 % fällig am 25.04.2035		19	18	0,00
4,356 % fällig am 25.08.2035		6	6	0,00
Mellon Residential Funding Corp. Mortgage Pass-Through Trust				
5,633 % fällig am 15.12.2030		1	1	0,00
Merrill Lynch Mortgage Investors Trust				
5,840 % fällig am 25.08.2036		3.500	3.292	0,34
New Residential Mortgage Loan Trust				
4,500 % fällig am 25.05.2058		428	409	0,04
Opteum Mortgage Acceptance Corp. Asset-Backed Pass-Through Certificates				
6,950 % fällig am 25.04.2035		500	480	0,05
Regal Trust				
3,910 % fällig am 29.09.2031		6	5	0,00
Residential Funding Mortgage Securities, Inc. Trust				
6,500 % fällig am 25.03.2032		6	6	0,00
Sequoia Mortgage Trust				
4,601 % fällig am 20.04.2035		17	16	0,00
5,557 % fällig am 20.07.2036		505	433	0,04
5,846 % fällig am 19.10.2026		3	2	0,00
Structured Asset Mortgage Investments Trust				
5,726 % fällig am 19.07.2034		2	1	0,00
5,806 % fällig am 19.10.2034		8	7	0,00
5,846 % fällig am 19.03.2034		6	6	0,00
Towd Point Mortgage Trust				
2,750 % fällig am 25.10.2056		264	261	0,03
3,250 % fällig am 25.03.2058		524	500	0,05
WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust				
5,376 % fällig am 25.06.2042		1	1	0,00
5,770 % fällig am 25.01.2045		10	10	0,00
5,890 % fällig am 25.01.2045		52	51	0,01
5,930 % fällig am 25.10.2044		154	142	0,02
			7.425	0,76
US-REGIERUNGSBEHÖRDEN				
Fannie Mae				
5,188 % fällig am 01.11.2034		157	156	0,02
5,720 % fällig am 25.09.2036		1	1	0,00
6,000 % fällig am 25.02.2044		4	4	0,00
6,500 % fällig am 25.06.2028		4	4	0,00
Freddie Mac				
4,350 % fällig am 01.01.2034		1	1	0,00
5,000 % fällig am 15.01.2035		157	155	0,02
5,290 % fällig am 25.09.2031		8	8	0,00
5,643 % fällig am 15.12.2031		1	1	0,00
5,693 % fällig am 15.04.2028		3	3	0,00
5,793 % fällig am 15.03.2024		0	0	0,00
5,843 % fällig am 15.03.2032		45	45	0,01
6,000 % fällig am 15.04.2036		3	3	0,00
Ginnie Mae				
2,887 % fällig am 20.10.2043		405	389	0,04
3,858 % fällig am 20.08.2068		519	505	0,05
5,284 % fällig am 20.07.2062		423	422	0,04
5,407 % fällig am 20.02.2035		24	24	0,00
5,617 % fällig am 20.08.2062		691	685	0,07
5,636 % fällig am 20.02.2038		13	13	0,00
5,710 % fällig am 20.03.2060		16	16	0,00

BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
Uniform Mortgage-Backed Security, TBA			
4,000 % fällig am 01.08.2053	$ 62.714	$ 58.910	6,05
4,500 % fällig am 01.08.2053	31.500	30.302	3,12
		91.647	9,42
US-SCHATZOBLIGATIONEN			
U.S. Treasury Inflation Protected Securities (a)			
0,125 % fällig am 15.07.2024 (e)	38.066	36.929	3,79
0,125 % fällig am 15.10.2024 (e)	75.543	72.873	7,49
0,125 % fällig am 15.04.2025 (e)(f)	36.167	34.411	3,54
0,125 % fällig am 15.10.2025	28.523	27.046	2,78
0,125 % fällig am 15.04.2026 (e)	51.733	48.520	4,99
0,125 % fällig am 15.07.2026	6.972	6.551	0,67
0,125 % fällig am 15.10.2026 (e)	128.648	120.297	12,36
0,125 % fällig am 15.07.2031	1.154	1.024	0,11
0,250 % fällig am 15.01.2025 (e)	44.436	42.603	4,38
0,250 % fällig am 15.07.2029	1.909	1.744	0,18
0,375 % fällig am 15.07.2025	19.932	19.077	1,96
0,375 % fällig am 15.01.2027	$ 27.323	$ 25.643	2,63
0,375 % fällig am 15.07.2027 (e)(f)	39.777	37.299	3,83
0,500 % fällig am 15.04.2024 (e)	30.462	29.728	3,05
0,500 % fällig am 15.01.2028	34.061	31.870	3,27
0,625 % fällig am 15.01.2026	20.833	19.868	2,04
0,750 % fällig am 15.07.2028	24.203	22.943	2,36
0,750 % fällig am 15.02.2045	773	639	0,07
0,875 % fällig am 15.02.2047	880	739	0,08
1,375 % fällig am 15.02.2044	2.993	2.822	0,29
1,500 % fällig am 15.02.2053	2.143	2.082	0,21
1,625 % fällig am 15.10.2027 (e)(f)	95.275	93.904	9,65
1,750 % fällig am 15.01.2028	5.137	5.079	0,52
2,375 % fällig am 15.01.2025	17.217	17.040	1,75
2,500 % fällig am 15.01.2029	1.708	1.760	0,18
3,875 % fällig am 15.04.2029	1.201	1.327	0,14
		703.818	72,32
Summe USA		824.657	84,74
KURZFRISTIGE INSTRUMENTE			
COMMERCIAL PAPER			
Ameren Corp.			
5,400 % fällig am 21.07.2023	$ 1.000	$ 997	0,10
5,400 % fällig am 24.07.2023	3.200	3.189	0,33
Virginia Electric & Power Co.			
5,330 % fällig am 13.07.2023	400	399	0,04
Summe kurzfristige Instrumente		4.585	0,47
Summe Übertragbare Wertpapiere		**$ 1.389.961**	**142,83**

BESCHREIBUNG	AKTIEN	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
INVESTMENTFONDS			
ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN			
PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (c)	12.345	123	0,01
Summe Investmentfonds		**$ 123**	**0,01**

PENSIONSGESCHÄFTE

Kontrahent	Kredit-zins	Abrechnungs-datum	Fälligkeits-datum	Kapital-betrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensions-geschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensions-geschäft[1]	% des Nettovermögens
FICC	2,400 %	30.06.2023	03.07.2023	$ 2.394	U.S. Treasury Notes 4,625 % fällig am 30.06.2025	$ (2.442)	$ 2.394	$ 2.394	0,25
Summe Pensionsgeschäfte						**$ (2.442)**	**$ 2.394**	**$ 2.394**	**0,25**

[1] Umfasst aufgelaufene Zinsen.

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

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

FUTURES

Beschreibung	Art	Ablauf-monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Australia Government 3-Year Note September Futures	Short	09.2023	69	$ 27	0,00
Australia Government 10-Year Bond September Futures	Short	09.2023	63	26	0,00
Euro-Bobl September Futures	Long	09.2023	326	(486)	(0,05)
Euro-BTP Italy Government Bond September Futures	Long	09.2023	16	(17)	0,00
Euro-BTP Italy Government Bond September Futures	Short	09.2023	339	376	0,04
Euro-Bund 10-Year Bond September Futures	Short	09.2023	731	514	0,05
Euro-Buxl 30-Year Bond September Futures	Short	09.2023	114	(215)	(0,02)
Euro-OAT France Government 10-Year Bond September Futures	Short	09.2023	15	12	0,00
Euro-Schatz September Futures	Short	09.2023	1.208	1.119	0,12
Japan Government 10-Year Bond September Futures	Short	09.2023	48	(177)	(0,02)
U.S. Treasury 2-Year Note September Futures	Short	09.2023	339	229	0,03
U.S. Treasury 5-Year Note September Futures	Short	09.2023	1.107	2.341	0,24
U.S. Treasury 10-Year Note September Futures	Long	09.2023	1.032	(2.044)	(0,21)
U.S. Treasury 10-Year Ultra September Futures	Short	09.2023	520	174	0,02
U.S. Treasury 30-Year Bond September Futures	Short	09.2023	548	(62)	(0,01)
U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond September Futures	Long	09.2023	111	200	0,02
United Kingdom Long Gilt September Futures	Short	09.2023	4	4	0,00
				$ 2.021	0,21

VERKAUFSOPTIONEN

OPTIONEN AUF BÖRSENGEHANDELTE TERMINKONTRAKTE

Beschreibung	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Anzahl der Kontrakte	Aufgeld	Markt-wert	% des Nettovermögens
Put - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note August Futures	$ 113,000	21.07.2023	153	$ (108)	$ (170)	(0,02)
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate					**$ 1.851**	**0,19**

ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)

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

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMMISSIONEN - SCHUTZVERKAUF[1]

Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag[2]	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
General Electric Co.	1,000 %	20.12.2023	$ 200	$ 13	0,00

ZINSSWAPS

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Erhalt	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	0,500 %	16.03.2042	£ 7.200	$ 587	0,06
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,300	20.09.2027	¥ 74.880	0	0,00
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,500	15.12.2031	2.466.000	(104)	(0,01)
Erhalt	1-Day USD-Federal Funds Rate Compounded-OIS	2,000	15.12.2047	$ 1.750	391	0,04
Erhalt	1-Day USD-Federal Funds Rate Compounded-OIS	2,428	20.12.2047	400	60	0,01
Erhalt	1-Day USD-Federal Funds Rate Compounded-OIS	2,478	20.12.2047	1.115	155	0,02
Erhalt	1-Day USD-Federal Funds Rate Compounded-OIS	2,499	20.12.2047	570	79	0,01
Erhalt[3]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,840	21.11.2028	13.800	1.318	0,14
Zahlung[3]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,880	25.01.2052	5.000	(1.403)	(0,14)
Zahlung[3]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,888	21.11.2053	2.800	(792)	(0,08)
Erhalt[3]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,865	13.02.2054	18.600	406	0,04
Zahlung[3]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,085	13.02.2034	41.800	(751)	(0,08)
Erhalt[3]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	4,250	20.12.2025	4.400	26	0,00
Zahlung	3-Month EUR-EURIBOR	0,526	21.11.2023	€ 9.900	(252)	(0,03)
Erhalt	3-Month NZD-BBR	3,250	21.03.2028	NZD 900	27	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,880	25.07.2023	$ 5.000	(20)	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	0,000	17.03.2053	€ 1.200	565	0,06
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	0,190	04.11.2052	900	413	0,04
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	0,195	04.11.2052	950	493	0,05
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	0,197	08.11.2052	1.600	731	0,08
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	0,550	10.08.2024	200	(9)	0,00
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	0,650	12.04.2027	4.900	(520)	(0,05)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	0,650	11.05.2027	2.400	(250)	(0,03)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	0,700	11.04.2027	2.100	(220)	(0,02)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	1,000	13.05.2027	4.700	(441)	(0,05)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	1,000	18.05.2027	2.100	(197)	(0,02)
Erhalt[3]	6-Month EUR-EURIBOR	2,500	20.09.2053	5.800	(74)	(0,01)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,879	15.08.2032	13.400	(165)	(0,02)
Zahlung[3]	6-Month EUR-EURIBOR	3,000	20.09.2033	91.100	662	0,07
Zahlung	CPTFEMU	1,066	15.02.2024	3.800	(565)	(0,06)
Zahlung	CPTFEMU	1,168	15.03.2024	3.300	(496)	(0,05)
Zahlung	CPTFEMU	1,380	15.03.2031	4.000	(891)	(0,09)
Zahlung	CPTFEMU	1,946	15.03.2048	60	(18)	0,00
Zahlung	CPTFEMU	2,421	15.05.2052	700	(115)	(0,01)
Erhalt	CPTFEMU	2,470	15.07.2032	11.900	381	0,04
Zahlung	CPTFEMU	2,488	15.05.2037	4.790	(365)	(0,04)
Erhalt	CPTFEMU	2,570	15.06.2032	8.800	340	0,03
Zahlung	CPTFEMU	2,580	15.03.2052	500	(66)	(0,01)
Zahlung	CPTFEMU	2,590	15.03.2052	4.940	(601)	(0,06)
Erhalt	CPTFEMU	2,600	15.05.2032	10.600	496	0,05
Zahlung	CPTFEMU	2,680	15.04.2053	2.100	(31)	0,00
Zahlung	CPTFEMU	2,700	15.04.2053	1.100	(15)	0,00
Zahlung	CPTFEMU	3,520	15.09.2024	13.600	(174)	(0,02)
Zahlung	CPTFEMU	3,720	15.09.2024	5.000	(34)	0,00
Zahlung	CPTFEMU	3,850	15.09.2024	19.500	(121)	(0,01)
Erhalt	CPTFEMU	4,375	15.06.2024	100.000	939	0,10
Erhalt	CPURNSA	1,798	25.08.2027	$ 1.000	144	0,01
Erhalt	CPURNSA	1,890	27.08.2027	3.000	414	0,04
Zahlung	CPURNSA	1,954	03.06.2029	700	(93)	(0,01)
Zahlung	CPURNSA	1,998	25.07.2029	3.600	(459)	(0,05)
Zahlung	CPURNSA	2,155	17.10.2027	1.900	(216)	(0,02)
Erhalt	CPURNSA	2,311	24.02.2031	5.100	548	0,06
Zahlung	CPURNSA	2,335	05.02.2028	2.680	(247)	(0,03)
Zahlung	CPURNSA	2,353	09.05.2028	1.790	(156)	(0,02)
Zahlung	CPURNSA	2,360	09.05.2028	2.690	(232)	(0,02)
Zahlung	CPURNSA	2,364	10.05.2028	2.750	(236)	(0,02)
Erhalt	CPURNSA	2,419	05.03.2026	2.300	215	0,02
Erhalt	CPURNSA	2,573	26.08.2028	1.100	68	0,01
Erhalt	CPURNSA	2,645	10.09.2028	1.500	81	0,01
Erhalt	CPURNSA	2,690	01.06.2026	2.100	157	0,02
Erhalt	CPURNSA	2,703	25.05.2026	1.270	95	0,01
Erhalt	CPURNSA	2,768	13.05.2026	3.100	226	0,02
Erhalt	CPURNSA	2,813	14.05.2026	1.400	99	0,01
Erhalt	FRCPXTOB	1,030	15.03.2024	€ 3.300	316	0,03
Zahlung	FRCPXTOB	1,910	15.01.2038	390	(75)	(0,01)
Zahlung	UKRPI	3,100	15.06.2031	£ 2.300	(523)	(0,05)
Zahlung	UKRPI	3,400	15.06.2030	1.610	(437)	(0,04)
Zahlung	UKRPI	3,515	15.02.2041	2.700	(445)	(0,05)

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Zahlung	UKRPI	3,530 %	15.10.2031	£ 540	$ (150)	(0,02)
Zahlung	UKRPI	3,566	15.03.2036	2.700	(552)	(0,06)
Zahlung	UKRPI	3,580	15.03.2036	2.000	(485)	(0,05)
Zahlung	UKRPI	4,066	15.09.2031	300	(54)	(0,01)
Erhalt	UKRPI	4,125	15.09.2032	590	30	0,00
Erhalt	UKRPI	4,130	15.09.2032	2.610	131	0,01
Erhalt	UKRPI	4,143	15.10.2032	2.300	112	0,01
Erhalt	UKRPI	4,480	15.09.2023	1.500	252	0,03
Erhalt	UKRPI	5,200	15.06.2024	1.200	78	0,01
Erhalt	UKRPI	6,600	15.05.2024	4.200	255	0,03
					$ (1.760)	(0,18)
Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate					**$ (1.747)**	**(0,18)**

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

(2) Der maximal mögliche Betrag, den der Fonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

(3) Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft.

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

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

OPTIONSKAUF

ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag(1)	Kosten	Markt-wert	% des Nettovermögens
DUB	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,237 %	17.11.2023	10.300	$ 639	$ 2.260	0,23

VERKAUFSOPTIONEN

INFLATION-CAPPED OPTIONS

Kontrahent	Beschreibung	Anfänglicher Index	Variabler Zinssatz	Verfalls-datum	Nenn-betrag(1)	Aufgeld	Markt-wert	% des Nettovermögens
GLM	Cap - OTC CPALEMU	$ 100,151	Maximalbetrag [(Fertiger Index/anfänglicher Index - 1) - 3,000 %] oder 0	22.06.2035	1.200	$ (55)	$ (68)	(0,01)

ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag(1)	Aufgeld	Markt-wert	% des Nettovermögens
BPS	Call - OTC 2-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,750 %	12.09.2023	24.700	$ (70)	$ (28)	0,00
DUB	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,340	17.11.2023	50.700	(639)	(3.740)	(0,39)
FAR	Call - OTC 2-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	4,420	21.09.2023	115.100	(655)	(492)	(0,05)
JPM	Call - OTC 2-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,750	12.09.2023	34.500	(96)	(40)	0,00
							$ (1.460)	$ (4.300)	(0,44)

(1) Der Nennbetrag stellt die Anzahl der Kontrakte dar.

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES - SCHUTZVERKAUF(1)

Kontrahent	Index/Tranchen	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag(2)	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Markt-wert	% des Nettovermögens
DUB	CMBX.NA.AAA.8 Index	0,500 %	17.10.2057	$ 1.500	$ (104)	$ 104	$ 0	0,00
GST	CMBX.NA.AAA.8 Index	0,500	17.10.2057	1.800	(94)	93	(1)	0,00
					$ (198)	$ 197	$ (1)	0,00

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

(2) Der maximal mögliche Betrag, den der Fonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

Aufstellung des Wertpapierbestands des Commodity Real Return Fund (Forts.)

ZINSSWAPS

Kontrahent	Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Markt-wert	% des Nettovermögens
BOA	Zahlung	3-Month ILS-TELBOR	1,998 %	20.06.2028	ILS 890	$ 0	$ (18)	$ (18)	0,00
BRC	Zahlung	3-Month ILS-TELBOR	1,950	20.06.2028	810	0	(17)	(17)	0,00
CKL	Zahlung	3-Month ILS-TELBOR	2,100	20.06.2028	750	(2)	(13)	(15)	0,00
GLM	Zahlung	3-Month ILS-TELBOR	1,971	16.02.2028	1.430	0	(27)	(27)	(0,01)
	Zahlung	3-Month ILS-TELBOR	1,998	20.06.2028	610	0	(13)	(13)	0,00
HUS	Zahlung	3-Month ILS-TELBOR	1,998	20.06.2028	480	0	(10)	(10)	0,00
						$ (2)	$ (98)	$ (100)	(0,01)

TOTAL RETURN SWAPS AUF INDIZES

Kontrahent	Zahlung/ Erhalt	Wertpapier	Anzahl der Anteile oder Einheiten	Variabler Zinssatz	Nenn-betrag	Fälligkeits-datum	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Markt-wert	% des Nettovermögens
BPS	Erhalt	BCOMTR Index	151.171	3-Month U.S. Treasury Bill-Zinssatz zzgl. eines bestimmten Spreads	$ 34.887	15.02.2024	$ 148	$ (839)	$ (691)	(0,07)
	Erhalt	BCOMTR1 Index	1.368.505	3-Month U.S. Treasury Bill-Zinssatz zzgl. eines bestimmten Spreads	120.736	15.02.2024	0	(2.378)	(2.378)	(0,24)
CBK	Erhalt	BCOMF1TC Index	348.889	3-Month U.S. Treasury Bill-Zinssatz zzgl. eines bestimmten Spreads	40.165	15.02.2024	0	(830)	(830)	(0,09)
	Erhalt	BCOMTR Index	55.650	3-Month U.S. Treasury Bill-Zinssatz zzgl. eines bestimmten Spreads	12.843	15.02.2024	0	(249)	(249)	(0,03)
	Erhalt	CIXBSTR3 Index	693.551	3-Month U.S. Treasury Bill-Zinssatz zzgl. eines bestimmten Spreads	176.505	15.02.2024	0	(3.573)	(3.573)	(0,37)
CIB	Erhalt	BCOMTR Index	179.997	3-Month U.S. Treasury Bill-Zinssatz zzgl. eines bestimmten Spreads	41.539	15.02.2024	0	(818)	(818)	(0,08)
FBF	Erhalt	BCOMTR Index	83.595	3-Month U.S. Treasury Bill-Zinssatz zzgl. eines bestimmten Spreads	19.292	15.02.2024	0	(380)	(380)	(0,04)
GST	Erhalt	BCOMF1TC Index	235.692	3-Month U.S. Treasury Bill-Zinssatz zzgl. eines bestimmten Spreads	87.988	15.02.2024	0	(1.818)	(1.818)	(0,19)
	Erhalt	BCOMTR Index	1.017.108	3-Month U.S. Treasury Bill-Zinssatz zzgl. eines bestimmten Spreads	234.725	15.02.2024	0	(4.622)	(4.622)	(0,47)
JPM	Erhalt	BCOMF1TC Index	315.223	3-Month U.S. Treasury Bill-Zinssatz zzgl. eines bestimmten Spreads	61.548	15.02.2024	0	(1.272)	(1.272)	(0,13)
	Erhalt	BCOMTR Index	90.706	3-Month U.S. Treasury Bill-Zinssatz zzgl. eines bestimmten Spreads	20.933	15.02.2024	0	(412)	(412)	(0,04)
	Erhalt	JMABDEWU Index	494.170	0,053 %	79.161	15.02.2024	0	541	541	0,06
	Erhalt	JMABNIU5 Index	164.986	0,000	29.494	15.02.2024	0	(167)	(167)	(0,02)
MAC	Erhalt	PIMCODBU Index	539.651	0,160	84.217	15.09.2023	0	(856)	(856)	(0,09)
MEI	Erhalt	BCOMTR Index	116.009	3-Month U.S. Treasury Bill-Zinssatz zzgl. eines bestimmten Spreads	26.772	15.02.2024	0	(527)	(527)	(0,05)
SOG	Erhalt	BCOMTR Index	9.776	3-Month U.S. Treasury Bill-Zinssatz zzgl. eines bestimmten Spreads	2.256	15.02.2024	0	(44)	(44)	0,00
							$ 148	$ (18.244)	$ (18.096)	(1,85)

DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung		Zu erhaltende Währung		Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
AZD	07.2023	AUD	326	$	213	$ 0	$ (4)	$ (4)	0,00
	07.2023	$	907	AUD	1.367	3	0	3	0,00
	08.2023	AUD	1.367	$	908	0	(3)	(3)	0,00
BOA	07.2023		2.074		1.354	0	(26)	(26)	0,00
	07.2023	DKK	194.210		28.045	0	(412)	(412)	(0,04)
	07.2023	NZD	823		500	0	(5)	(5)	0,00
	07.2023	$	11.728	DKK	79.740	0	(44)	(44)	0,00
	07.2023		552	€	510	5	0	5	0,00
	08.2023	DKK	79.606	$	11.728	44	0	44	0,00
BPS	07.2023	€	2.909		3.171	0	(3)	(3)	0,00
	07.2023	¥	8.376.035		60.288	2.335	0	2.335	0,24
	07.2023	NZD	74		45	0	(1)	(1)	0,00
	07.2023	$	647	AUD	977	3	0	3	0,00
	07.2023		288.740	€	263.534	6	(1.231)	(1.225)	(0,13)
	08.2023	AUD	977	$	648	0	(3)	(3)	0,00
	08.2023	€	261.997		287.474	1.243	0	1.243	0,13
BRC	09.2023	ILS	87		24	1	0	1	0,00
CBK	07.2023	CAD	3.615		2.653	0	(79)	(79)	(0,01)
	07.2023	€	1.446		1.560	0	(17)	(17)	0,00
	07.2023	¥	88.700		628	14	0	14	0,00
	07.2023	$	922	€	843	0	(2)	(2)	0,00
GLM	07.2023		2.347	DKK	16.270	37	0	37	0,00
JPM	07.2023	AUD	1.993	$	1.303	0	(24)	(24)	0,00
	07.2023	$	1.662	DKK	11.360	6	(4)	2	0,00
	07.2023		20.157	¥	2.882.631	0	(213)	(213)	(0,02)
	08.2023	¥	2.870.382	$	20.157	213	0	213	0,02
	09.2023	ILS	83		23	1	0	1	0,00
	09.2023	PEN	3.744		1.017	0	(10)	(10)	0,00

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung		Zu erhaltende Währung		Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
MBC	07.2023	£	96.657	$	119.648	$ 0	$ (3.237)	$ (3.237)	(0,33)
	07.2023	SEK	1.796		167	1	0	1	0,00
	07.2023	$	1.083	€	1.011	21	0	21	0,00
MYI	07.2023	£	5	$	7	0	0	0	0,00
	07.2023	SEK	138.692		12.920	80	0	80	0,01
	07.2023	$	9.688	DKK	66.084	0	(5)	(5)	0,00
	07.2023		821	€	754	1	0	1	0,00
	07.2023		38	£	30	0	0	0	0,00
	07.2023		13.033	SEK	140.706	0	(6)	(6)	0,00
	08.2023	DKK	65.973	$	9.688	5	0	5	0,00
	08.2023	SEK	140.532		13.033	6	0	6	0,00
SCX	07.2023	AUD	2.813		1.838	0	(34)	(34)	0,00
	07.2023	NZD	2.144		1.302	0	(12)	(12)	0,00
	07.2023	$	1.332	AUD	2.007	4	0	4	0,00
	07.2023		40	€	37	0	0	0	0,00
	07.2023		287	£	228	2	0	2	0,00
	08.2023	AUD	2.007	$	1.333	0	(4)	(4)	0,00
SOG	07.2023		2.152		1.408	0	(24)	(24)	0,00
	07.2023	€	260.006		279.699	0	(3.967)	(3.967)	(0,41)
TOR	07.2023	AUD	1.139		745	0	(13)	(13)	0,00
	07.2023	$	1.631	AUD	2.470	13	0	13	0,00
	07.2023		2.733	CAD	3.616	2	(2)	0	0,00
	07.2023		122.822	£	96.657	63	0	63	0,01
	07.2023		38.762	¥	5.581.716	0	(143)	(143)	(0,02)
	07.2023		1.852	NZD	3.042	11	0	11	0,00
	08.2023	AUD	2.470	$	1.633	0	(13)	(13)	0,00
	08.2023	CAD	3.614		2.733	2	(2)	0	0,00
	08.2023	£	96.657		122.849	0	(61)	(61)	(0,01)
	08.2023	¥	5.558.044		38.762	145	0	145	0,01
	08.2023	NZD	3.042		1.852	0	(11)	(11)	0,00
UAG	07.2023	AUD	261		171	0	(3)	(3)	0,00
	07.2023	$	2.629	AUD	3.937	6	(14)	(8)	0,00
	08.2023	AUD	3.937	$	2.631	13	(5)	8	0,00
	09.2023	ILS	72		20	1	0	1	0,00
						$ 4.287	$ (9.637)	$ (5.350)	(0,55)

ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklassen Institutional EUR (Hedged) thesaurierend und Class E EUR (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung		Zu erhaltende Währung		Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2023	€	1.350	$	1.460	$ 0	$ (13)	$ (13)	0,00
	07.2023	$	112.515	€	104.694	1.707	0	1.707	0,17
BPS	07.2023	€	100.729	$	110.360	469	(4)	465	0,05
	07.2023	$	111.227	€	103.466	1.656	0	1.656	0,17
	08.2023		98.812		90.055	0	(428)	(428)	(0,04)
CBK	07.2023	€	92.343	$	100.383	7	(371)	(364)	(0,04)
	07.2023	$	4.918	€	4.496	0	(13)	(13)	0,00
	08.2023		91.575		84.111	316	0	316	0,03
JPM	07.2023	€	88.670	$	96.818	80	0	80	0,01
	07.2023	$	13.010	€	12.168	266	0	266	0,03
	08.2023		96.954		88.670	0	(83)	(83)	(0,01)
MBC	07.2023	€	6.466	$	6.934	0	(120)	(120)	(0,01)
	07.2023	$	2.526	€	2.316	5	(4)	1	0,00
MYI	07.2023	€	25.263	$	27.608	46	0	46	0,00
SOG	07.2023	$	111.303	€	103.466	1.580	0	1.580	0,16
UAG	07.2023	€	16.025	$	17.197	0	(287)	(287)	(0,03)
						$ 6.132	$ (1.323)	$ 4.809	0,49

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklasse Institutional GBP (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung		Zu erhaltende Währung		Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2023	£	2.883	$	3.664	$ 0	$ (1)	$ (1)	0,00
BPS	07.2023	$	14.295	£	11.546	387	(3)	384	0,04
BRC	07.2023	£	10.134	$	12.906	57	(34)	23	0,00
	07.2023	$	416	£	327	0	(1)	(1)	0,00
CBK	07.2023	£	530	$	671	0	(3)	(3)	0,00
	07.2023	$	713	£	558	0	(3)	(3)	0,00
JPM	07.2023	£	7.179	$	9.077	0	(50)	(50)	(0,01)
	08.2023	$	9.079	£	7.179	50	0	50	0,01
MBC	07.2023	£	287	$	357	0	(7)	(7)	0,00
	07.2023	$	14.062	£	11.359	380	0	380	0,04
MYI	07.2023		14.110		11.353	323	0	323	0,03
						$ 1.197	$ (102)	$ 1.095	0,11

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklasse Class E SGD (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung		Zu erhaltende Währung		Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
GLM	07.2023	SGD	86	$	64	$ 1	$ 0	$ 1	0,00
	07.2023	$	88	SGD	119	0	0	0	0,00
JPM	07.2023	SGD	402	$	297	0	0	0	0,00
	07.2023	$	303	SGD	410	0	0	0	0,00
	08.2023		297		402	0	0	0	0,00
MBC	07.2023		280		379	(1)	0	(1)	0,00
	08.2023	SGD	5	$	3	0	0	0	0,00
MYI	07.2023		399		295	0	0	0	0,00
	08.2023	$	295	SGD	399	0	0	0	0,00
UAG	07.2023	SGD	19	$	14	0	0	0	0,00
	07.2023	$	306	SGD	414	0	0	0	0,00
						$ 0	$ 0	$ 0	0,00

Summe Freiverkehrsfinanzderivate	**$ (19.751)**	**(2,03)**
Summe Anlagen	**$ 1.372.831**	**141,07**
Sonstige Aktiva und Passiva	**$ (399.665)**	**(41,07)**
Nettovermögen	**$ 973.166**	**100,00**

ERLÄUTERUNGEN ZUR AUFSTELLUNG DES WERTPAPIERBESTANDS (Angaben in Tausend*):

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

^ **Das Wertpapier ist in Verzug.**

(a) **Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.**

(b) **Unbegrenzte Laufzeit; das gegebenenfalls angegebene Datum stellt den nächsten vertraglichen Kündigungstermin dar**

(c) **Mit dem Fonds verbunden.**

(d) **Bedingt wandelbares Wertpapier.**

(e) **Wertpapiere mit einem gesamten beizulegenden Zeitwert von 339.204 USD (31. Dezember 2022: 400.193 USD) wurden zum 30. Juni 2023 gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte als Sicherheit verpfändet.**

(f) **Wertpapiere mit einem gesamten beizulegenden Zeitwert von 22.916 USD (31. Dezember 2022: 17.272 USD) wurden zum 30. Juni 2023 gemäß den Rahmenverträgen für Wertpapier-Termingeschäfte für verzögert gelieferte Wertpapiere oder Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte als Sicherheit verpfändet oder geliefert.**

Wertpapiere mit einem gesamten beizulegenden Zeitwert von null USD (31. Dezember 2022: 157 USD) wurden zum 30. Juni 2023 gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte als Sicherheit geliefert.

Barmittel in Höhe von 18.308 USD (31. Dezember 2022: 19.275 USD) wurden zum 30. Juni 2023 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Barmittel in Höhe von 31.670 USD (31. Dezember 2022: 18.770 USD) wurden zum 30. Juni 2023 gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. als Sicherheit für Finanzderivate verpfändet.

Beizulegender Zeitwert[1]

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 30. Juni 2023 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie[2]	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	$ 0	$ 1.389.738	$ 223	$ 1.389.961
Investmentfonds	123	0	0	123
Pensionsgeschäfte	0	2.394	0	2.394
Finanzderivate[3]	1.183	(20.830)	0	(19.647)
Summen	**$ 1.306**	**$ 1.371.302**	**$ 223**	**$ 1.372.831**

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

Kategorie[2]	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	$ 0	$ 1.750.918	$ 0	$ 1.750.918
Investmentfonds	120	0	0	120
Pensionsgeschäfte	0	59.113	0	59.113
Finanzderivate[3]	8.938	(13.669)	0	(4.731)
Summen	**$ 9.058**	**$ 1.796.362**	**$ 0**	**$ 1.805.420**

(1) Siehe Erläuterung 3 in den Erläuterungen zum Abschluss für weitere Informationen.

(2) Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung des Wertpapierbestands.

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

Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2023:

Kontrahent	Kredit-zins	Abrechnungs-datum	Fälligkeits-datum	Kredit-betrag	Verbindlichkeiten aus umgekehrten Pensions-geschäften	% des Nettovermögens
BOS	5,160 %	27.06.2023	18.07.2023	$ (12.093)	$ (12.100)	(1,24)
	5,180	15.06.2023	13.07.2023	(5.010)	(5.021)	(0,52)
	5,180	20.06.2023	13.07.2023	(193.962)	(194.269)	(19,96)
	5,180	26.06.2023	17.07.2023	(9.043)	(9.049)	(0,93)
GRE	5,180	17.05.2023	17.07.2023	(107.165)	(107.859)	(11,08)
IND	5,210	28.06.2023	05.07.2023	(10.952)	(10.956)	(1,13)
Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte					**$ (339.254)**	**(34,86)**

Ausstehende Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte zum 30. Juni 2023:

Kontrahent	Kredit-zins	Abrechnungs-datum	Fälligkeits-datum	Kredit-betrag	Zahlbar für Rückkauf-Finanzierungs-geschäfte[1]	% des Nettovermögens
BPG	5,190 %	21.06.2023	05.07.2023	$ (13.231)	$ (13.250)	(1,36)
TDM	5,180	28.06.2023	12.07.2023	(2.126)	(2.126)	(0,22)
	5,200	29.06.2023	13.07.2023	(7.703)	(7.705)	(0,79)
Summe Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte					**$ (23.081)**	**(2,37)**

(1) In dem für Rückkaufgeschäfte zahlbaren Betrag sind 24 USD für einen aufgeschobenen Kursrückgang enthalten.

Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC-Finanzderivate und -Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2023 und 31. Dezember 2022:

	Zum 30. Jun. 2023			Zum 31. Dez. 2022		
Kontrahent	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-engagement[1]	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-engagement[1]
AZD	$ (4)	$ 10	$ 6	$ k. A.	$ k. A.	$ k. A.
BOA	1.237	(980)	257	(97)	0	(97)
BPS	1.329	480	1.809	(3.167)	4.390	1.223
BRC	6	0	6	311	(320)	(9)
CBK	(4.803)	7.320	2.517	2.368	(1.310)	1.058
CIB	(818)	1.280	462	(334)	470	136
CKL	(15)	0	(15)	(14)	0	(14)
DUB	(1.480)	1.190	(290)	(1.532)	1.480	(52)
FAR	(492)	670	178	k. A.	k. A.	k. A.
FBF	(380)	430	50	(181)	80	(101)
GLM	(70)	70	0	(384)	260	(124)
GSC	k. A.	k. A.	k. A.	(3)	0	(3)
GST	(6.441)	10.230	3.789	(3.474)	4.890	1.416
HUS	(10)	0	(10)	(10)	0	(10)
JPM	(1.118)	3.150	2.032	(272)	1.520	1.248
MAC	(856)	1.470	614	1.137	(840)	297
MBC	(2.962)	2.240	(722)	(3.160)	2.770	(390)
MEI	(527)	830	303	(251)	320	69
MYC	k. A.	k. A.	k. A.	(26)	260	234
MYI	450	(460)	(10)	(2.190)	1.630	(560)
RBC	k. A.	k. A.	k. A.	(1)	0	(1)
SAL	k. A.	k. A.	k. A.	(6)	100	94
SCX	(44)	0	(44)	4.186	(4.010)	176
SOG	(2.455)	2.010	(445)	(497)	570	73
TOR	(9)	0	(9)	k. A.	k. A.	k. A.
UAG	(289)	290	1	(10)	30	20

(1) Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären.

Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung des Wertpapierbestands zum 30. Juni 2023:

	30. Jun. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	122,37	108,79
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	20,43	18,76
Sonstige übertragbare Wertpapiere	0,03	0,26
Investmentfonds	0,01	0,01
Pensionsgeschäfte	0,25	4,32
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	0,19	0,64
Zentral abgerechnete Finanzderivate	(0,18)	(0,43)
Freiverkehrsfinanzderivate	(2,03)	(0,56)
Umgekehrte Pensionsgeschäfte	(34,86)	(31,05)
Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte	(2,37)	(1,31)

Das Anlageportfolio des Fonds konzentriert sich zum 30. Juni 2023 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	30. Jun. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
Australien	0,73	0,51
Kanada	0,25	0,18
Cayman-Inseln	4,93	5,01
Dänemark	2,48	3,73
Frankreich	7,82	5,36
Deutschland	k. A.	1,07
Irland	5,48	4,58
Italien	10,13	6,97
Japan	6,47	4,89
Niederlande	k. A.	0,03
Neuseeland	0,20	0,14
Peru	0,01	0,04
Katar	k. A.	0,02
Saudi-Arabien	k. A.	0,02
Spanien	5,24	3,61
Schweden	1,35	0,99
Schweiz	0,10	k. A.
Großbritannien	12,43	8,89
USA	84,74	81,68
Kurzfristige Instrumente	0,47	0,09
Investmentfonds	0,01	0,01
Pensionsgeschäfte	0,25	4,32
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	0,21	0,64
Verkaufsoptionen		
Optionen auf börsengehandelte Terminkontrakte	(0,02)	k. A.
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	0,00	0,00
Zinsswaps	(0,18)	(0,43)
Freiverkehrsfinanzderivate		
Optionskauf		
Zinsswapoptionen	0,23	0,22
Verkaufsoptionen		
Credit Default Swaptions auf Kreditindizes	k. A.	0,00
Inflation-Capped Options	(0,01)	0,00
Zinsswapoptionen	(0,44)	(0,35)
Credit Default Swaps auf Kreditindizes– Schutzverkauf	0,00	0,00
Zinsswaps	(0,01)	(0,01)
Total Return Swaps auf Indizes	(1,85)	(0,68)
Devisenterminkontrakte	(0,55)	(0,62)
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	0,60	0,88
Sonstige Aktiva und Passiva	(41,07)	(31,79)
Nettovermögen	100,00	100,00

BESCHREIBUNG		PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE				
ARGENTINIEN				
STAATSEMISSIONEN				
Argentina Government International Bond				
1,000 % fällig am 09.07.2029	$	13	$ 4	0,00
3,500 % fällig am 09.07.2041		800	258	0,26
Provincia de Buenos Aires				
88,734 % fällig am 12.04.2025 (a)	ARS	20	0	0,00
Summe Argentinien			262	0,26
AUSTRALIEN				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Santos Finance Ltd.				
3,649 % fällig am 29.04.2031	$	1.100	914	0,92
Virgin Australia Holdings Pty. Ltd				
8,125 % fällig am 15.11.2024 ^		377	1	0,00
Summe Australien			915	0,92
BERMUDA				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Valaris Ltd.				
8,375 % fällig am 30.04.2030		300	301	0,30
Weatherford International Ltd.				
6,500 % fällig am 15.09.2028		400	402	0,40
Summe Bermuda			703	0,70
BRASILIEN				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Vale Overseas Ltd.				
6,875 % fällig am 10.11.2039		375	393	0,39
KANADA				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Air Canada Pass-Through Trust				
3,300 % fällig am 15.07.2031		38	34	0,03
CAYMAN INSELN				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Kaisa Group Holdings Ltd.				
11,500 % fällig am 30.01.2023 ^		600	40	0,04
Sands China Ltd.				
4,875 % fällig am 18.06.2030		300	267	0,27
Sunac China Holdings Ltd.				
5,950 % fällig am 26.04.2024 ^		450	68	0,07
Transocean Titan Financing Ltd.				
8,375 % fällig am 01.02.2028		300	307	0,30
Wynn Macau Ltd.				
5,500 % fällig am 01.10.2027		100	89	0,09
Summe Cayman Inseln			771	0,77
CHINA				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Yango Justice International Ltd.				
7,500 % fällig am 15.04.2024 ^		200	4	0,01
9,250 % fällig am 15.04.2023 ^		200	2	0,00
Summe China			6	0,01
TSCHECHISCHE REPUBLIK				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
EP Infrastructure A/S				
1,816 % fällig am 02.03.2031	€	400	307	0,31
FRANKREICH				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Altice France S.A.				
5,125 % fällig am 15.07.2029	$	725	515	0,52
BNP Paribas S.A.				
3,132 % fällig am 20.01.2033		600	493	0,49
7,750 % fällig am 16.08.2029 (e)(g)		200	194	0,20
Societe Generale S.A.				
3,337 % fällig am 21.01.2033		450	361	0,36

BESCHREIBUNG		PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
6,691 % fällig am 10.01.2034	$	500	$ 509	0,51
Summe Frankreich			2.072	2,08
IRLAND				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
AerCap Ireland Capital DAC				
2,875 % fällig am 14.08.2024		1.150	1.106	1,11
ITALIEN				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Intesa Sanpaolo SpA				
4,950 % fällig am 01.06.2042		200	132	0,13
Mundys SpA				
1,875 % fällig am 12.02.2028	€	300	280	0,28
Nexi SpA				
2,125 % fällig am 30.04.2029		400	365	0,37
Societa per Azioni Esercizi Aeroportuali SEA SpA				
3,500 % fällig am 09.10.2025		200	207	0,21
Summe Italien			984	0,99
JAPAN				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc.				
5,133 % fällig am 20.07.2033	$	500	491	0,49
Nomura Holdings, Inc.				
1,851 % fällig am 16.07.2025		200	183	0,18
2,999 % fällig am 22.01.2032		375	304	0,31
Summe Japan			978	0,98
		AKTIEN		
LUXEMBURG				
STAMMAKTIEN				
Intelsat Emergence S.A. (d)(h)		7.480	172	0,17
		PAR (000S)		
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Constellation Oil Services Holding S.A. (3,000 % bar und 4,000 % PIK)				
3,000 % fällig am 31.12.2026 (c)	$	520	308	0,31
Intelsat Jackson Holdings S.A.				
6,500 % fällig am 15.03.2030		562	513	0,51
			821	0,82
KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG				
Intelsat Jackson Holdings S.A.				
9,443 % fällig am 01.02.2029		139	139	0,14
		AKTIEN		
RECHTE				
Intelsat Jackson Holdings S.A. - Exp. 05.12.2025		1.566	9	0,01
Summe Luxemburg			1.141	1,14
		PAR (000S)		
MEXIKO				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Petroleos Mexicanos				
10,000 % fällig am 07.02.2033	$	100	92	0,09
MULTINATIONAL				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Delta Air Lines, Inc.				
4,750 % fällig am 20.10.2028		400	388	0,39
NXP BV				
3,250 % fällig am 11.05.2041		875	638	0,64
Summe multinational			1.026	1,03
NIEDERLANDE				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Prosus NV				
3,832 % fällig am 08.02.2051		300	184	0,19

BESCHREIBUNG		PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
SÜDAFRIKA				
STAATSEMISSIONEN				
South Africa Government International Bond				
10,500 % fällig am 21.12.2026	ZAR	26.800	$ 1.473	1,48

BESCHREIBUNG		PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
SPANIEN				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Cellnex Finance Co. S.A.				
1,500 % fällig am 08.06.2028	€	400	374	0,37
SCHWEIZ				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Credit Suisse AG				
4,713 % fällig am 31.05.2024		400	435	0,44
UBS Group AG				
4,988 % fällig am 05.08.2033	$	500	464	0,46
6,442 % fällig am 11.08.2028		400	402	0,40
6,537 % fällig am 12.08.2033		250	256	0,26
Summe Schweiz			1.557	1,56
GROSSBRITANNIEN				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Barclays PLC				
5,746 % fällig am 09.08.2033		500	484	0,48
Gazprom PJSC Via Gaz Finance PLC				
2,950 % fällig am 27.01.2029		500	312	0,31
Grainger PLC				
3,000 % fällig am 03.07.2030	£	200	193	0,19
HSBC Holdings PLC				
4,600 % fällig am 17.12.2030 (e)(g)	$	300	229	0,23
5,402 % fällig am 11.08.2033		250	244	0,24
INEOS Quattro Finance PLC				
2,500 % fällig am 15.01.2026	€	100	98	0,10
John Lewis PLC				
4,250 % fällig am 18.12.2034	£	300	238	0,24
Market Bidco Finco PLC				
4,750 % fällig am 04.11.2027	€	800	705	0,71
National Grid PLC				
5,809 % fällig am 12.06.2033	$	50	51	0,05
Virgin Media Secured Finance PLC				
4,125 % fällig am 15.08.2030	£	300	296	0,30
Vmed O2 UK Financing PLC				
3,250 % fällig am 31.01.2031	€	375	337	0,34
Summe Großbritannien			3.187	3,19
USA				
FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE				
ACE Securities Corp. Home Equity Loan Trust				
5,975 % fällig am 25.12.2045 ^	$	277	210	0,21
Argent Securities Trust				
5,300 % fällig am 25.09.2036		761	251	0,25
5,510 % fällig am 25.04.2036		267	88	0,09
5,710 % fällig am 25.04.2036		653	216	0,22
Citigroup Mortgage Loan Trust				
5,470 % fällig am 25.12.2036		1.612	906	0,91
First Franklin Mortgage Loan Trust				
6,575 % fällig am 25.10.2034		290	289	0,29
GSAMP Trust				
5,240 % fällig am 25.01.2037		370	216	0,22
5,270 % fällig am 25.12.2036		525	258	0,26
5,380 % fällig am 25.12.2046		646	326	0,33
MASTR Asset-Backed Securities Trust				
5,630 % fällig am 25.08.2036		471	185	0,18
Merrill Lynch Mortgage Investors Trust				
5,270 % fällig am 25.11.2037		69	24	0,02
Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust				
5,280 % fällig am 25.01.2037		343	158	0,16
5,290 % fällig am 25.10.2036		268	116	0,12
5,450 % fällig am 25.09.2036		1.769	666	0,67
5,610 % fällig am 25.09.2036		59	26	0,02
Morgan Stanley Home Equity Loan Trust				
5,250 % fällig am 25.04.2037		61	32	0,03
Morgan Stanley Mortgage Loan Trust				
6,465 % fällig am 25.09.2046 ^		611	208	0,21

BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
New Century Home Equity Loan Trust			
8,150 % fällig am 25.01.2033 ^	$ 62	$ 53	0,05
NovaStar Mortgage Funding Trust			
5,450 % fällig am 25.06.2036	517	364	0,36
5,450 % fällig am 25.09.2036	842	366	0,37
Option One Mortgage Loan Trust			
5,400 % fällig am 25.03.2037	500	247	0,25
Residential Asset Mortgage Products Trust			
5,610 % fällig am 25.12.2035	1.106	887	0,89
Residential Asset Securities Corp. Trust			
4,916 % fällig am 25.08.2034	361	345	0,34
Securitized Asset-Backed Receivables LLC Trust			
6,110 % fällig am 25.01.2036 ^	112	97	0,10
Soundview Home Loan Trust			
5,330 % fällig am 25.07.2037	247	211	0,21
Specialty Underwriting & Residential Finance Trust			
5,450 % fällig am 25.09.2037	348	241	0,24
		6.986	7,00

	AKTIEN		
STAMMAKTIEN			
ENERGIE			
Constellation Oil Services Holding S.A. 'B' (d)(h)	580.149	63	0,06
FINANZWERTE			
Stearns Holdings LLC 'B' (d)	157.159	0	0,00
Summe Stammaktien		63	0,06

	PAR (000S)		
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Alaska Airlines Pass-Through Trust			
4,800 % fällig am 15.02.2029	$ 322	309	0,31
Alleghany Corp.			
3,250 % fällig am 15.08.2051	225	161	0,16
Allstate Corp.			
5,750 % fällig am 15.08.2053	100	99	0,10
American Airlines Pass-Through Trust			
3,375 % fällig am 01.11.2028	360	323	0,32
American Homes 4 Rent LP			
3,375 % fällig am 15.07.2051	600	394	0,40
American Tower Corp.			
2,700 % fällig am 15.04.2031	300	249	0,25
2,950 % fällig am 15.01.2051	1.125	711	0,71
5,550 % fällig am 15.07.2033	200	202	0,20
Aviation Capital Group LLC			
3,500 % fällig am 01.11.2027	400	354	0,35
Bank of America Corp.			
5,015 % fällig am 22.07.2033	1.350	1.321	1,32
BGC Partners, Inc.			
8,000 % fällig am 25.05.2028	50	48	0,05
Boeing Co.			
3,950 % fällig am 01.08.2059	600	444	0,45
5,705 % fällig am 01.05.2040	600	599	0,60
5,805 % fällig am 01.05.2050	100	100	0,10
Brandywine Operating Partnership LP			
3,950 % fällig am 15.11.2027	250	199	0,20
7,550 % fällig am 15.03.2028	200	180	0,18
British Airways Pass-Through Trust			
3,300 % fällig am 15.06.2034	86	75	0,08
Broadcom, Inc.			
3,187 % fällig am 15.11.2036	5	4	0,00
3,469 % fällig am 15.04.2034	525	431	0,43
4,150 % fällig am 15.04.2032	675	612	0,61
Brookfield Capital Finance LLC			
6,087 % fällig am 14.06.2033	100	102	0,10
Caesars Entertainment, Inc.			
7,000 % fällig am 15.02.2030	250	251	0,25
Centene Corp.			
2,450 % fällig am 15.07.2028	625	535	0,54
CenterPoint Energy Houston Electric LLC			
4,950 % fällig am 01.04.2033	100	100	0,10
Charter Communications Operating LLC			
3,950 % fällig am 30.06.2062	575	354	0,35
Cheniere Energy Partners LP			
4,500 % fällig am 01.10.2029	$ 700	$ 643	0,64
5,950 % fällig am 30.06.2033	100	100	0,10
Chesapeake Energy Corp.			
5,500 % fällig am 01.02.2026	100	98	0,10
6,750 % fällig am 15.04.2029	200	199	0,20
Choice Hotels International, Inc.			
3,700 % fällig am 15.01.2031	150	127	0,13
Comstock Resources, Inc.			
6,750 % fällig am 01.03.2029	200	183	0,18
Continental Resources, Inc.			
5,750 % fällig am 15.01.2031	500	475	0,48
DCP Midstream Operating LP			
3,250 % fällig am 15.02.2032	200	170	0,17
Diamond Sports Group LLC			
5,375 % fällig am 15.08.2026 ^	400	14	0,01
Duke Energy Corp.			
4,500 % fällig am 15.08.2032	100	94	0,09
5,000 % fällig am 15.08.2052	100	91	0,09
Edison International			
6,950 % fällig am 15.11.2029	100	105	0,11
Endeavor Energy Resources LP			
5,750 % fällig am 30.01.2028	325	318	0,32
Energy Transfer LP			
5,000 % fällig am 15.05.2044	500	422	0,42
EnLink Midstream LLC			
6,500 % fällig am 01.09.2030	100	100	0,10
Entergy Corp.			
3,750 % fällig am 15.06.2050	100	74	0,07
EQM Midstream Partners LP			
4,500 % fällig am 15.01.2029	100	89	0,09
EQT Corp.			
5,000 % fällig am 15.01.2029	325	306	0,31
Equifax, Inc.			
5,100 % fällig am 01.06.2028	50	49	0,05
Equinix, Inc.			
3,000 % fällig am 15.07.2050	450	292	0,29
Expedia Group, Inc.			
3,250 % fällig am 15.02.2030	400	348	0,35
Global Atlantic Fin Co.			
3,125 % fällig am 15.06.2031	300	226	0,23
Global Payments, Inc.			
5,400 % fällig am 15.08.2032	600	585	0,59
5,950 % fällig am 15.08.2052	400	383	0,38
GLP Capital LP			
4,000 % fällig am 15.01.2030	600	521	0,52
Goodman U.S. Finance Five LLC			
4,625 % fällig am 04.05.2032	50	46	0,05
HCA, Inc.			
3,500 % fällig am 01.09.2030	350	307	0,31
4,625 % fällig am 15.03.2052	725	596	0,60
Host Hotels & Resorts LP			
2,900 % fällig am 15.12.2031	500	394	0,39
3,375 % fällig am 15.12.2029	100	86	0,09
3,500 % fällig am 15.09.2030	925	785	0,79
Howard Midstream Energy Partners LLC			
8,875 % fällig am 15.07.2028 (b)	300	302	0,30
Hudson Pacific Properties LP			
3,950 % fällig am 01.11.2027	300	218	0,22
5,950 % fällig am 15.02.2028	100	80	0,08
Hyundai Capital America			
5,500 % fällig am 30.03.2026	100	99	0,10
Infor, Inc.			
1,450 % fällig am 15.07.2023	100	100	0,10
JPMorgan Chase & Co.			
4,912 % fällig am 25.07.2033	1.000	978	0,98
5,000 % fällig am 01.08.2024 (e)	100	97	0,10
Marriott International, Inc.			
4,900 % fällig am 15.04.2029	50	49	0,05
Mattel, Inc.			
3,375 % fällig am 01.04.2026	900	829	0,83
Mileage Plus Holdings LLC			
6,500 % fällig am 20.06.2027	80	80	0,08
Moody's Corp.			
3,100 % fällig am 29.11.2061	475	313	0,31
Morgan Stanley			
4,889 % fällig am 20.07.2033	$ 1.450	$ 1.396	1,40
6,342 % fällig am 18.10.2033	50	53	0,05
MSCI, Inc.			
3,625 % fällig am 01.11.2031	1.100	940	0,94
4,000 % fällig am 15.11.2029	100	91	0,09
Newell Brands, Inc.			
4,875 % fällig am 01.06.2025	275	265	0,27
Nissan Motor Acceptance Co. LLC			
2,450 % fällig am 15.09.2028	500	400	0,40
Occidental Petroleum Corp.			
7,500 % fällig am 01.05.2031	500	547	0,55
Pacific Gas & Electric Co.			
2,500 % fällig am 01.02.2031	200	157	0,16
3,150 % fällig am 01.01.2026	300	279	0,28
3,950 % fällig am 01.12.2047 ^	425	290	0,29
4,550 % fällig am 01.07.2030	100	91	0,09
Philip Morris International, Inc.			
5,375 % fällig am 15.02.2033	300	299	0,30
PRA Health Sciences, Inc.			
2,875 % fällig am 15.07.2026	300	272	0,27
SBA Communications Corp.			
3,125 % fällig am 01.02.2029	200	170	0,17
Sealed Air Corp.			
1,573 % fällig am 15.10.2026	450	392	0,39
Southern California Edison Co.			
3,650 % fällig am 01.02.2050	400	298	0,30
Southern California Gas Co.			
5,200 % fällig am 01.06.2033	100	99	0,10
Station Casinos LLC			
4,625 % fällig am 01.12.2031	700	590	0,59
Sysco Corp.			
3,150 % fällig am 14.12.2051	425	295	0,30
T-Mobile USA, Inc.			
3,600 % fällig am 15.11.2060	575	404	0,41
Time Warner Cable Enterprises LLC			
8,375 % fällig am 15.07.2033	100	110	0,11
Travel + Leisure Co.			
6,625 % fällig am 31.07.2026	100	99	0,10
United Airlines, Inc.			
4,375 % fällig am 15.04.2026	250	238	0,24
Venture Global Calcasieu Pass LLC			
3,875 % fällig am 15.08.2029	1.675	1.465	1,47
3,875 % fällig am 01.11.2033	300	246	0,25
4,125 % fällig am 15.08.2031	300	258	0,26
VICI Properties LP			
3,875 % fällig am 15.02.2029	625	549	0,55
Vistra Operations Co. LLC			
3,550 % fällig am 15.07.2024	300	290	0,29
3,700 % fällig am 30.01.2027	200	183	0,18
Vornado Realty LP			
2,150 % fällig am 01.06.2026	600	509	0,51
Wells Fargo & Co.			
3,526 % fällig am 24.03.2028	100	93	0,09
4,897 % fällig am 25.07.2033	1.100	1.056	1,06
Weyerhaeuser Co.			
4,000 % fällig am 09.03.2052	1.125	900	0,90
4,750 % fällig am 15.05.2026	100	98	0,10
7,375 % fällig am 15.03.2032	99	111	0,11
		33.061	33,13
NON-AGENCY-MBS			
Banc of America Funding Trust			
6,000 % fällig am 25.07.2037	183	146	0,15
BCAP LLC Trust			
5,590 % fällig am 25.05.2047 ^	157	151	0,15
Bear Stearns Adjustable Rate Mortgage Trust			
4,222 % fällig am 25.07.2036 ^	45	40	0,04
Countrywide Alternative Loan Trust			
5,347 % fällig am 20.09.2046	7	7	0,01
5,376 % fällig am 25.08.2035	11	11	0,01
5,500 % fällig am 25.12.2035 ^	268	153	0,15
5,530 % fällig am 25.09.2046 ^	5	4	0,00
5,636 % fällig am 25.07.2035	143	129	0,13
6,000 % fällig am 25.10.2035 ^	12	8	0,01
6,000 % fällig am 25.08.2037 ^	113	85	0,09

BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
6,500 % fällig am 25.08.2037 ^	$ 1.880	$ 825	0,83
7,798 % fällig am 25.09.2037	288	242	0,24
Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust			
3,287 % fällig am 25.09.2037 ^	70	63	0,06
5,750 % fällig am 25.07.2037 ^	7	4	0,00
Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp.			
6,000 % fällig am 25.09.2035	229	75	0,08
Credit Suisse Mortgage Capital Certificates			
2,796 % fällig am 29.12.2037	638	353	0,35
Credit Suisse Mortgage Capital Mortgage-Backed Trust			
6,000 % fällig am 25.07.2036	144	76	0,08
6,500 % fällig am 25.10.2021 ^	157	10	0,01
Deutsche ALT-A Securities Mortgage Loan Trust			
5,290 % fällig am 25.07.2047	13	12	0,01
5,300 % fällig am 25.02.2047	3.165	1.934	1,94
5,530 % fällig am 25.10.2036 ^	171	54	0,05
Deutsche ALT-A Securities, Inc. Mortgage Loan Trust			
3,238 % fällig am 25.08.2035 ^	12	10	0,01
First Horizon Alternative Mortgage Securities Trust			
4,226 % fällig am 25.08.2035 ^	5	4	0,00
Freddie Mac			
5,992 % fällig am 25.11.2055	636	367	0,37
Impac Secured Assets Trust			
5,450 % fällig am 25.11.2036	37	36	0,04
IndyMac Mortgage Loan Trust			
3,216 % fällig am 25.12.2034	239	224	0,22
3,629 % fällig am 25.05.2037 ^	57	48	0,05
5,650 % fällig am 25.02.2037	22	14	0,01
JPMorgan Mortgage Trust			
6,500 % fällig am 25.07.2036 ^	243	98	0,10
Lehman XS Trust			
5,510 % fällig am 25.07.2037 ^	273	251	0,25
6,050 % fällig am 25.08.2047 ^	187	157	0,16
Morgan Stanley Mortgage Loan Trust			
3,103 % fällig am 25.11.2037	194	128	0,13
Residential Accredit Loans, Inc. Trust			
4,834 % fällig am 25.12.2035 ^	16	13	0,01
4,873 % fällig am 25.07.2035	2	2	0,00

BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
5,500 % fällig am 25.08.2035 ^	$ 19	$ 15	0,01
5,900 % fällig am 25.11.2036 ^	513	375	0,38
Residential Asset Securitization Trust			
5,750 % fällig am 25.03.2037 ^	227	75	0,08
6,000 % fällig am 25.02.2036	322	148	0,15
6,250 % fällig am 25.11.2036 ^	480	192	0,19
Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust			
5,630 % fällig am 25.05.2037 ^	75	66	0,07
Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates Trust			
5,500 % fällig am 25.05.2035 ^	1.232	971	0,97
		7.576	7,59
US-REGIERUNGSBEHÖRDEN			
Ginnie Mae, TBA			
2,500 % fällig am 01.08.2053	100	87	0,09
Uniform Mortgage-Backed Security			
3,000 % fällig am 01.05.2052	98	87	0,09
Uniform Mortgage-Backed Security, TBA			
2,000 % fällig am 01.08.2053	100	82	0,08
2,500 % fällig am 01.08.2053	1.100	934	0,94
4,000 % fällig am 01.08.2053	9.200	8.642	8,66
4,500 % fällig am 01.08.2053	4.700	4.521	4,53
5,000 % fällig am 01.09.2053	1.000	980	0,98
		15.333	15,37
US-SCHATZOBLIGATIONEN			
U.S. Treasury Notes			
0,500 % fällig am 31.10.2027	9.900	8.452	8,47
	AKTIEN		
OPTIONSSCHEINE			
Guaranteed Rate, Inc. - Exp. 31.12.2060	753	0	0,00
Vistra Corp. - Exp. 02.02.2024	31.815	2	0,00
		2	0,00
Summe USA		71.473	71,62

BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
JUNGFERNINSELN (BRITISCH)			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Studio City Finance Ltd.			
5,000 % fällig am 15.01.2029	$ 150	$ 111	0,11
KURZFRISTIGE INSTRUMENTE			
COMMERCIAL PAPER			
AT+T, Inc.			
5,700 % fällig am 19.03.2024	400	383	0,39
Constellation Brands, Inc.			
5,580 % fällig am 25.07.2023	250	249	0,25
VW Credit, Inc.			
5,430 % fällig am 01.08.2023	250	249	0,25
Summe kurzfristige Instrumente		881	0,89
Summe Übertragbare Wertpapiere		**$ 90.030**	**90,22**
	AKTIEN		
INVESTMENTFONDS			
ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN			
PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (f)	925.129	9.212	9,23
PIMCO Specialty Funds Ireland p.l.c. - PIMCO China Bond Fund (f)	9.239	121	0,12
		9.333	9,35
BÖRSENGEHANDELTE FONDS			
PIMCO ETFs plc - PIMCO US Dollar Short Maturity UCITS ETF (f)	4.000	397	0,40
Summe Investmentfonds		**$ 9.730**	**9,75**

PENSIONSGESCHÄFTE

Kontrahent	Kredit-zins	Abrechnungs-datum	Fälligkeits-datum	Kapital-betrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensions-geschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensions-geschäft[1]	% des Nettovermögens
BPS	5,160 %	30.06.2023	03.07.2023	$ 12.600	U.S. Treasury Notes 2,000 % fällig am 15.08.2025	$ (12.869)	$ 12.600	$ 12.605	12,63
SSB	2,400	30.06.2023	03.07.2023	553	U.S. Treasury Notes 1,875 % fällig am 30.06.2026	(564)	553	553	0,55
Summe Pensionsgeschäfte						**$ (13.433)**	**$ 13.153**	**$ 13.158**	**13,18**

[1] Umfasst aufgelaufene Zinsen.

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

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

FUTURES

Beschreibung	Art	Ablauf-monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
3-Month SOFR December Futures	Short	03.2024	50	$ 340	0,34
Euro-Bund 10-Year Bond September Futures	Short	09.2023	3	4	0,00
U.S. Treasury 10-Year Note September Futures	Short	09.2023	90	174	0,18
U.S. Treasury 10-Year Ultra September Futures	Short	09.2023	53	18	0,02
U.S. Treasury 30-Year Bond September Futures	Short	09.2023	52	3	0,00
U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond September Futures	Short	09.2023	13	(26)	(0,03)
				$ 513	0,51

VERKAUFSOPTIONEN

OPTIONEN AUF BÖRSENGEHANDELTE TERMINKONTRAKTE

Beschreibung	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Anzahl der Kontrakte	Aufgeld	Markt-wert	% des Nettovermögens
Put - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note August Futures	$ 111,500	21.07.2023	2	$ (1)	$ (1)	0,00
Call - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note August Futures	115,500	21.07.2023	2	(1)	0	0,00

Beschreibung	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Anzahl der Kontrakte	Aufgeld	Markt-wert	% des Nettovermögens
Put - CBOT U.S. Treasury 30-Year Bond August Futures	$ 123,000	21.07.2023	1	$ 1	$ 0	0,00
Call - CBOT U.S. Treasury 30-Year Bond August Futures	131,000	21.07.2023	1	(1)	0	0,00
				$ (2)	$ (1)	0,00
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate					**$ 512**	**0,51**

ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)

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

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMMISSIONEN - SCHUTZKAUF[1]

Referenzeinheit	Zu bezahlender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag[3]	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
AutoZone, Inc.	(1,000) %	20.06.2024	$ 1.400	$ 26	0,03
Bath & Body Works, Inc.	(1,000)	20.12.2023	350	(28)	(0,03)
ConocoPhillips	(1,000)	20.12.2024	100	(1)	0,00
Johnson Controls International PLC	(1,000)	20.12.2024	1.500	36	0,04
Lowe's Cos., Inc.	(1,000)	20.12.2023	700	14	0,01
Tyson Foods, Inc.	(1,000)	20.06.2024	1.400	30	0,03
				$ 77	0,08

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMMISSIONEN - SCHUTZVERKAUF[2]

Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag[3]	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
AT&T, Inc.	1,000 %	20.06.2027	$ 100	$ 2	0,00
AT&T, Inc.	1,000	20.06.2028	100	1	0,00
MetLife, Inc.	1,000	20.12.2024	100	(1)	0,00
Rolls-Royce PLC	1,000	20.06.2025	€ 100	20	0,02
Rolls-Royce PLC	1,000	20.12.2025	200	15	0,02
T-Mobile USA, Inc.	5,000	20.06.2028	$ 300	1	0,00
Toll Brothers Finance Corp.	1,000	20.06.2026	200	3	0,00
Verizon Communications, Inc.	1,000	20.06.2028	100	0	0,00
				$ 41	0,04

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES - SCHUTZKAUF[1]

Index/Tranchen	Zu bezahlender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag[3]	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
CDX.IG-40 5-Year Index	(1,000) %	20.06.2028	$ 2.700	$ (19)	(0,02)

ZINSSWAPS

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Erhalt[4]	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	3,250 %	20.09.2053	£ 100	$ 7	0,01
Erhalt[4]	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	3,500	20.09.2033	200	16	0,01
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,000	15.09.2027	¥ 94.200	6	0,01
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,800	10.03.2028	$ 200	(2)	0,00
Erhalt	3-Month CNY-CNREPOFIX	2,250	21.12.2027	CNY 29.000	(51)	(0,05)
Erhalt	3-Month ZAR-JIBAR	7,300	28.04.2027	ZAR 15.500	33	0,03
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	0,000	17.03.2053	€ 440	207	0,20
Erhalt[4]	6-Month EUR-EURIBOR	3,000	20.09.2028	300	1	0,00
Erhalt[4]	6-Month EUR-EURIBOR	3,000	20.09.2033	600	(2)	0,00
					$ 215	0,21
Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate					**$ 314**	**0,31**

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

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

(3) Der maximal mögliche Betrag, den der Fonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

(4) Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft.

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

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

OPTIONSKAUF

ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag[1]	Kosten	Markt-wert	% des Nettovermögens
BOA	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	0,021 %	25.10.2023	1.500	$ 86	$ 380	0,38

VERKAUFSOPTIONEN

ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag[1]	Aufgeld	Markt-wert	% des Nettovermögens
BOA	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,380 %	31.07.2023	100	$ (1)	$ (1)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,780	31.07.2023	100	(1)	0	0,00
	Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,070	10.07.2023	100	(1)	0	0,00
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,370	10.07.2023	100	(1)	0	0,00
	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	0,020	25.10.2023	7.500	(86)	(675)	(0,68)
JPM	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,300	10.07.2023	100	(1)	0	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,750	10.07.2023	100	0	0	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,250	20.07.2023	100	0	0	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,650	20.07.2023	100	0	(1)	0,00
MYC	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,300	10.07.2023	100	0	0	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,750	10.07.2023	100	0	0	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,270	24.07.2023	100	0	0	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,670	24.07.2023	100	0	0	0,00
							$ (91)	$ (677)	(0,68)

(1) Der Nennbetrag stellt die Anzahl der Kontrakte dar.

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMMISSIONEN - SCHUTZKAUF[1]

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu bezahlender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag[3]	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Markt-wert	% des Nettovermögens
CBK	Mexico Government International Bond	(1,000) %	20.12.2023	$ 2.200	$ 25	$ (35)	$ (10)	(0,01)

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMMISSIONEN - SCHUTZVERKAUF[2]

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag[3]	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Markt-wert	% des Nettovermögens
BRC	Pertamina Persero PT	1,000 %	20.12.2024	$ 100	$ 0	$ 1	$ 1	0,00

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES - SCHUTZVERKAUF[2]

Kontrahent	Index/Tranchen	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag[3]	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Markt-wert	% des Nettovermögens
CBK	CDX.HY-31 5-Year Index 25-35 %	5,000 %	20.12.2023	$ 100	$ 10	$ (7)	$ 3	0,00
GST	CDX.HY-31 5-Year Index 25-35 %	5,000	20.12.2023	200	23	(18)	5	0,01
JPM	CDX.HY-31 5-Year Index 25-35 %	5,000	20.12.2023	300	39	(32)	7	0,01
					$ 72	$ (57)	$ 15	0,02

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

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

(3) Der maximal mögliche Betrag, den der Fonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

TOTAL RETURN SWAPS AUF INDIZES UND WERTPAPIERE

Kontrahent	Zahlung/Erhalt	Wertpapier	Anzahl der Anteile oder Einheiten	Variabler Zinssatz	Nenn-betrag	Fälligkeits-datum	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Markt-wert	% des Nettovermögens
BPS	Erhalt	iBoxx USD Liquid High Yield Index	k. A.	1,084 %	$ 4.800	20.03.2024	$ 58	$ (51)	$ 7	0,01

DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung		Zu erhaltende Währung		Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
AZD	07.2023	AUD	46	$	31	$ 0	$ 0	$ 0	0,00
	08.2023	$	31	AUD	46	0	0	0	0,00
BOA	07.2023		535	¥	77.192	0	0	0	0,00
	09.2023		30	IDR	455.342	0	0	0	0,00
BPS	07.2023	AUD	33	$	22	0	0	0	0,00
	07.2023	$	3.155	€	2.879	0	(14)	(14)	(0,01)
	07.2023		984	¥	136.749	0	(38)	(38)	(0,04)
	08.2023	CNH	471	$	68	3	0	3	0,00
	08.2023	€	2.879		3.159	14	0	14	0,01
	08.2023	$	22	AUD	33	0	0	0	0,00
	08.2023	ZAR	6.873	$	373	11	0	11	0,01
	09.2023	$	30	IDR	443.820	0	0	0	0,00
	10.2023	ZAR	4.960	$	267	7	0	7	0,01
BRC	08.2023	$	266	COP	1.134.924	2	0	2	0,00
	08.2023	ZAR	1.862	$	101	3	0	3	0,00
	09.2023	IDR	1.771		0	0	0	0	0,00
	09.2023	$	52	PEN	190	0	0	0	0,00
CBK	07.2023	€	262	$	281	0	(5)	(5)	0,00
	07.2023	PEN	2.936		756	0	(55)	(55)	(0,05)
	07.2023	$	1.108	PEN	4.093	22	0	22	0,02
	08.2023	CLP	177.617	$	216	0	(3)	(3)	0,00
	08.2023	$	217	CLP	177.617	3	0	3	0,00
	08.2023		85	NOK	887	0	(2)	(2)	0,00
DUB	07.2023	PEN	4.000	$	1.097	0	(6)	(6)	(0,01)
	07.2023	$	129	BRL	701	16	0	16	0,02
	07.2023		547	PEN	2.000	5	0	5	0,00
	10.2023	ZAR	2.201	$	121	6	0	6	0,01
GLM	07.2023	BRL	704		146	0	0	0	0,00
	07.2023	PEN	736		201	0	(1)	(1)	0,00
	07.2023	$	14	PEN	51	0	0	0	0,00
	08.2023		106	NOK	1.128	0	(1)	(1)	0,00
	08.2023		99	PEN	362	0	0	0	0,00
	09.2023		146	BRL	711	0	0	0	0,00
	09.2023		132	PEN	485	1	0	1	0,00
	10.2023	ZAR	2.847	$	152	3	0	3	0,00
JPM	07.2023	¥	46.569		326	3	0	3	0,00
	07.2023	MXN	52		3	0	0	0	0,00
	08.2023	CNH	223		32	1	0	1	0,00
	08.2023	$	326	¥	46.371	0	(3)	(3)	0,00
	08.2023		39	NOK	416	0	0	0	0,00
	08.2023		101	ZAR	1.856	0	(4)	(4)	0,00
	09.2023		13	IDR	192.077	0	0	0	0,00
	09.2023		164	INR	13.526	0	0	0	0,00
MBC	07.2023	£	562	$	696	0	(19)	(19)	(0,02)
MYI	07.2023	IDR	120.037		8	0	0	0	0,00
	07.2023	$	29	€	27	0	0	0	0,00
	07.2023		8	IDR	120.037	0	0	0	0,00
	09.2023		45		665.056	0	0	0	0,00
	09.2023		35	INR	2.921	0	0	0	0,00
RBC	07.2023		22	MXN	415	3	0	3	0,00
	08.2023		468		8.114	1	0	1	0,00
SCX	07.2023	AUD	68	$	45	0	0	0	0,00
	08.2023	CNH	106		15	1	0	1	0,00
	08.2023	$	45	AUD	68	0	0	0	0,00
	09.2023		182	IDR	2.714.606	0	(2)	(2)	0,00
	09.2023		103	INR	8.459	0	0	0	0,00
	09.2023		98	PEN	360	1	0	1	0,00
SOG	07.2023	€	2.617	$	2.815	0	(41)	(41)	(0,04)
	07.2023	$	105	AUD	161	2	0	2	0,00
SSB	07.2023		548	PEN	2.000	3	0	3	0,00
	08.2023	PEN	2.000	$	548	0	(3)	(3)	0,00
TOR	07.2023	AUD	83		55	0	0	0	0,00
	07.2023	$	56	AUD	85	1	0	1	0,00
	07.2023		714	£	562	0	0	0	0,00
	08.2023	£	562	$	714	0	0	0	0,00
	08.2023	$	55	AUD	83	0	0	0	0,00
UAG	07.2023	AUD	40	$	27	0	0	0	0,00
	07.2023	$	19	AUD	29	0	0	0	0,00
	08.2023		27		40	0	0	0	0,00
	08.2023	ZAR	5.607	$	292	0	(3)	(3)	0,00
	09.2023		3.978		227	19	0	19	0,02
						$ 131	$ (200)	$ (69)	(0,07)

ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklasse Institutional CHF (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung		Zu erhaltende Währung		Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2023	$	103	CHF	93	$ 0	$ 0	$ 0	0,00
BPS	07.2023	CHF	4.184	$	4.678	2	0	2	0,00
	07.2023	$	6.696	CHF	6.058	75	0	75	0,08
	08.2023		4.678		4.172	0	(2)	(2)	0,00
DUB	07.2023	CHF	1.356	$	1.499	0	(17)	(17)	(0,02)
MYI	07.2023		21		24	0	0	0	0,00
SCX	07.2023	$	4.949	CHF	4.447	21	0	21	0,02
UAG	07.2023	CHF	4.315	$	4.813	0	(9)	(9)	(0,01)
	07.2023	$	4.464	CHF	4.011	19	0	19	0,02
	08.2023		4.813		4.302	10	0	10	0,01
						$ 127	$ (28)	$ 99	0,10

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklassen Institutional EUR (Hedged) thesaurierend und Class E EUR (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung		Zu erhaltende Währung		Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2023	€	35	$	38	$ 0	$ 0	$ 0	0,00
	07.2023	$	9.060	€	8.430	138	0	138	0,14
BPS	07.2023	€	8.985	$	9.844	42	0	42	0,04
	07.2023	$	9.091	€	8.456	134	0	134	0,13
	08.2023		9.791		8.923	0	(43)	(43)	(0,04)
CBK	07.2023	€	8.930	$	9.709	1	(34)	(33)	(0,03)
	07.2023	$	154	€	143	2	0	2	0,00
	08.2023		9.644		8.858	33	0	33	0,03
JPM	07.2023	€	8.912	$	9.731	8	0	8	0,01
	08.2023	$	9.745	€	8.912	0	(8)	(8)	(0,01)
MBC	07.2023	€	68	$	73	0	(1)	(1)	0,00
	07.2023	$	83	€	77	1	0	1	0,00
MYI	07.2023		1.533		1.413	8	0	8	0,01
SOG	07.2023		9.047		8.410	128	0	128	0,13
						$ 495	$ (86)	$ 409	0,41

Summe Freiverkehrsfinanzderivate	**$ 155**	**0,16**
Summe Anlagen	**$ 113.894**	**114,13**
Sonstige Aktiva und Passiva	**$ (14.098)**	**(14,13)**
Nettovermögen	**$ 99.796**	**100,00**

ERLÄUTERUNGEN ZUR AUFSTELLUNG DES WERTPAPIERBESTANDS (Angaben in Tausend*):

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

^ **Das Wertpapier ist in Verzug.**

(a) **Bei dem Wertpapier handelt es sich um ein Interest Only- („IO“) bzw. IO-Strip.**

(b) **Wertpapier per Emissionstermin.**

(c) **Wertpapier mit Sachwertausschüttung.**

(d) **Das Wertpapier hat in den letzten zwölf Monaten keine Erträge geliefert.**

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

(f) **Mit dem Fonds verbunden.**

(g) **Bedingt wandelbares Wertpapier.**

(h) **Eingeschränkte Wertpapiere (31. Dezember 2022: 1,99 %):**

Emittentenbeschreibung	Kauf-datum	Kosten	Markt-wert	% des Nettovermögens
Constellation Oil Services Holding S.A. ‘B’	10.06.2022	$ 63	$ 63	0,06
Intelsat Emergence S.A.	12.11.2019	750	172	0,17
		$ 813	$ 235	0,23

Barmittel in Höhe von 1.387 USD (31. Dezember 2022: 1.243 USD) wurden zum 30. Juni 2023 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Barmittel in Höhe von 300 USD (31. Dezember 2022: 290 USD) wurden zum 30. Juni 2023 gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. als Sicherheit für Finanzderivate verpfändet.

Beizulegender Zeitwert[1]

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 30. Juni 2023 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie[2]	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	$ 2	$ 88.633	$ 1.395	$ 90.030
Investmentfonds	9.730	0	0	9.730
Pensionsgeschäfte	0	13.153	0	13.153
Finanzderivate[3]	4	977	0	981
Summen	**$ 9.736**	**$ 102.763**	**$ 1.395**	**$ 113.894**

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

Kategorie[2]	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	$ 8	$ 79.539	$ 648	$ 80.195
Investmentfonds	9.253	396	0	9.649
Pensionsgeschäfte	0	6.910	0	6.910
Finanzderivate[3]	33	393	0	426
Summen	**$ 9.294**	**$ 87.238**	**$ 648**	**$ 97.180**

(1) Siehe Erläuterung 3 in den Erläuterungen zum Abschluss für weitere Informationen.

(2) Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung des Wertpapierbestands.

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

Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC-Finanzderivate und -Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2023 und 31. Dezember 2022:

	Zum 30. Jun. 2023			Zum 31. Dez. 2022		
Kontrahent	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-engagement[1]	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-engagement[1]
AZD	$ k. A.	$ k. A.	$ k. A.	$ (14)	$ 0	$ (14)
BOA	(158)	300	142	(104)	0	(104)
BPS	198	(260)	(62)	(290)	290	0
BRC	6	0	6	5	0	5
CBK	(45)	0	(45)	555	(550)	5
DUB	4	0	4	4	(40)	(36)
GLM	2	0	2	(23)	0	(23)
GST	5	0	5	9	0	9
JPM	3	0	3	(63)	0	(63)
MBC	(19)	0	(19)	120	0	120
MYC	k. A.	k. A.	k. A.	(5)	0	(5)
MYI	8	(50)	(42)	4	0	4
RBC	4	0	4	3	0	3
SCX	21	0	21	253	0	253
SOG	89	0	89	k. A.	k. A.	k. A.
TOR	1	0	1	k. A.	k. A.	k. A.
UAG	36	0	36	(8)	0	(8)

(1) Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären.

Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung des Wertpapierbestands zum 30. Juni 2023:

	30. Jun. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	42,31	40,41
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	47,90	40,99
Sonstige übertragbare Wertpapiere	0,01	1,15
Investmentfonds	9,75	9,93
Pensionsgeschäfte	13,18	7,11
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	0,51	0,41
Zentral abgerechnete Finanzderivate	0,31	(0,43)
Freiverkehrsfinanzderivate	0,16	0,46

Das Anlageportfolio des Fonds konzentriert sich zum 30. Juni 2023 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	30. Jun. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
Argentinien	0,26	0,24
Australien	0,92	0,90
Bermuda	0,70	k. A.
Brasilien	0,39	0,41
Kanada	0,03	0,94
Cayman-Inseln	0,77	0,64

Anlagen zum Marktwert	30. Jun. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
China	0,01	0,02
Tschechische Republik	0,31	k. A.
Frankreich	2,08	1,06
Irland	1,11	k. A.
Italien	0,99	0,34
Japan	0,98	0,80
Luxemburg	1,14	1,17
Mexiko	0,09	k. A.
Multinational	1,03	1,02
Niederlande	0,19	0,95
Peru	k. A.	0,74
Katar	k. A.	0,40
Südafrika	1,48	1,71
Spanien	0,37	0,37
Schweiz	1,56	1,08
Großbritannien	3,19	3,36
USA	71,62	65,91
Jungferninseln (Britisch)	0,11	0,23
Kurzfristige Instrumente	0,89	0,26
Investmentfonds	9,75	9,93
Pensionsgeschäfte	13,18	7,11
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	0,51	0,41
Verkaufsoptionen		
Optionen auf börsengehandelte Terminkontrakte	0,00	k. A.
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen - Schutzkauf	0,08	0,08
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	0,04	0,04
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzkauf	(0,02)	k. A.
Zinsswaps	0,21	(0,55)
Freiverkehrsfinanzderivate		
Optionskauf		
Zinsswapoptionen	0,38	0,63
Verkaufsoptionen		
Credit Default Swaptions auf Kreditindizes	k. A.	0,00
Zinsswapoptionen	(0,68)	(1,06)
Optionen auf Wertpapiere	k. A.	(0,01)
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen - Schutzkauf	(0,01)	(0,01)
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	0,00	0,00
Credit Default Swaps auf Kreditindizes– Schutzverkauf	0,02	0,03
Total Return Swaps auf Indizes	0,01	(0,16)
Devisenterminkontrakte	(0,07)	(0,04)
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	0,51	1,08
Sonstige Aktiva und Passiva	(14,13)	(0,03)
Nettovermögen	100,00	100,00

Aufstellung des Wertpapierbestands des Diversified Income Fund

BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE			
ALBANIEN			
STAATSEMISSIONEN			
Albania Government International Bond			
3,500 % fällig am 16.06.2027 €	16.800	$ 16.928	0,21
ARGENTINIEN			
STAATSEMISSIONEN			
Argentina Government International Bond			
1,500 % fällig am 09.07.2035 $	26.928	8.122	0,10
3,500 % fällig am 09.07.2041	133.299	42.925	0,54
Summe Argentinien		51.047	0,64
AUSTRALIEN			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
CIMIC Finance Ltd.			
1,500 % fällig am 28.05.2029 €	100	86	0,00
Pacific National Finance Pty. Ltd.			
4,750 % fällig am 22.03.2028 $	1.000	909	0,01
Santos Finance Ltd.			
3,649 % fällig am 29.04.2031	3.200	2.659	0,03
Woodside Finance Ltd.			
3,700 % fällig am 15.09.2026	600	565	0,01
4,500 % fällig am 04.03.2029	2.200	2.076	0,03
Summe Australien		6.295	0,08
BERMUDA			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Aircastle Ltd.			
2,850 % fällig am 26.01.2028	9.900	8.430	0,11
4,250 % fällig am 15.06.2026	1.600	1.508	0,02
5,250 % fällig am 11.08.2025	32.800	31.708	0,40
Bacardi Ltd.			
4,700 % fällig am 15.05.2028	22.840	22.104	0,28
NCL Corp. Ltd.			
8,375 % fällig am 01.02.2028	1.000	1.046	0,01
Summe Bermuda		64.796	0,82
BRASILIEN			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Odebrecht Oil & Gas Finance Ltd.			
0,000 % fällig am 31.07.2023 (c)(d)	13.194	34	0,00
KANADA			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Air Canada Pass-Through Trust			
3,300 % fällig am 15.07.2031	770	683	0,01
4,125 % fällig am 15.11.2026	1.094	1.023	0,01
5,250 % fällig am 01.10.2030	3.086	2.995	0,04
B.C. Unlimited Liability Co.			
4,000 % fällig am 15.10.2030	5.000	4.285	0,06
Enbridge, Inc.			
5,700 % fällig am 08.03.2033	2.000	2.028	0,03
Fairfax Financial Holdings Ltd.			
2,750 % fällig am 29.03.2028 €	21.850	21.477	0,27
4,850 % fällig am 17.04.2028 $	200	193	0,00
Open Text Corp.			
3,875 % fällig am 15.02.2028	3.000	2.645	0,03
Summe Kanada		35.329	0,45
CAYMAN INSELN			
FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE			
Atlas Senior Loan Fund Ltd.			
6,410 % fällig am 16.01.2030	1.350	1.344	0,02
Catamaran CLO Ltd.			
6,373 % fällig am 22.04.2030	3.969	3.946	0,05
OZLM Ltd.			
6,348 % fällig am 16.05.2030	3.998	3.970	0,05
Venture CLO Ltd.			
6,311 % fällig am 07.09.2030	7.475	7.413	0,09
6,350 % fällig am 20.01.2029	5.237	5.201	0,07
Vibrant CLO Ltd.			
6,290 % fällig am 15.09.2030	1.756	1.736	0,02
		23.610	0,30
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Avolon Holdings Funding Ltd.			
2,528 % fällig am 18.11.2027 $	12.810	$ 10.814	0,14
2,875 % fällig am 15.02.2025	9.400	8.747	0,11
3,250 % fällig am 15.02.2027	4.900	4.370	0,06
4,250 % fällig am 15.04.2026	3.600	3.356	0,04
5,250 % fällig am 15.05.2024	1.200	1.179	0,01
5,500 % fällig am 15.01.2026	10.500	10.180	0,13
Diamond Foreign Asset Co. (9,000 % bar oder 9,000 % PIK)			
9,000 % fällig am 22.04.2027 (a)	1.468	1.417	0,02
Gaci First Investment Co.			
4,875 % fällig am 14.02.2035	5.000	4.800	0,06
5,125 % fällig am 14.02.2053	12.100	10.905	0,14
Kaisa Group Holdings Ltd.			
9,375 % fällig am 30.06.2024 ^	9.850	655	0,01
9,750 % fällig am 28.09.2023 ^	22.900	1.532	0,02
10,500 % fällig am 15.01.2025 ^	21.600	1.445	0,02
10,875 % fällig am 23.07.2023 ^	5.800	370	0,00
11,250 % fällig am 16.04.2025 ^	17.000	1.137	0,01
11,500 % fällig am 30.01.2023 ^	900	60	0,00
11,650 % fällig am 01.06.2026 ^	9.300	622	0,01
11,700 % fällig am 11.11.2025 ^	5.750	385	0,00
11,950 % fällig am 12.11.2023 ^	4.400	358	0,00
Lima Metro Line Finance Ltd.			
5,875 % fällig am 05.07.2034	2.707	2.635	0,03
Melco Resorts Finance Ltd.			
4,875 % fällig am 06.06.2025	3.400	3.243	0,04
5,375 % fällig am 04.12.2029	8.900	7.394	0,09
5,750 % fällig am 21.07.2028	1.000	885	0,01
MGM China Holdings Ltd.			
4,750 % fällig am 01.02.2027	400	364	0,00
New Metro Global Ltd.			
4,500 % fällig am 02.05.2026	1.200	507	0,01
Park Aerospace Holdings Ltd.			
5,500 % fällig am 15.02.2024	504	498	0,01
Sands China Ltd.			
3,350 % fällig am 08.03.2029	500	417	0,01
Seagate HDD Cayman			
4,125 % fällig am 15.01.2031	5.318	4.363	0,06
9,625 % fällig am 01.12.2032	8.386	9.263	0,12
Seazen Group Ltd.			
4,450 % fällig am 13.07.2025	12.500	6.500	0,08
Sunac China Holdings Ltd.			
5,950 % fällig am 26.04.2024 ^	19.200	2.882	0,04
6,500 % fällig am 09.07.2023 ^	4.800	745	0,01
6,500 % fällig am 26.01.2026 ^	300	45	0,00
6,650 % fällig am 03.08.2024 ^	5.900	871	0,01
7,000 % fällig am 09.07.2025 ^	7.400	1.119	0,01
7,250 % fällig am 14.06.2022 ^	30.400	4.523	0,06
7,500 % fällig am 01.02.2024 ^	5.500	826	0,01
7,950 % fällig am 11.10.2023 ^	11.800	1.777	0,02
8,350 % fällig am 19.04.2023 ^	1.100	163	0,00
Trafford Centre Finance Ltd.			
5,402 % fällig am 28.07.2038 £	3.700	3.926	0,05
Wynn Macau Ltd.			
4,875 % fällig am 01.10.2024 $	300	293	0,00
5,500 % fällig am 15.01.2026	7.600	7.068	0,09
5,625 % fällig am 26.08.2028	1.700	1.485	0,02
		124.124	1,56
Summe Cayman Inseln		147.734	1,86
CHILE			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Empresa de Transporte de Pasajeros Metro S.A.			
3,650 % fällig am 07.05.2030	3.800	3.486	0,04
GNL Quintero S.A.			
4,634 % fällig am 31.07.2029	3.212	3.126	0,04
Summe Chile		6.612	0,08
CHINA			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Yango Justice International Ltd.			
7,500 % fällig am 15.04.2024 ^	28.200	592	0,01
7,500 % fällig am 17.02.2025 ^	19.100	167	0,00
7,875 % fällig am 04.09.2024 ^	19.800	297	0,00
Summe China		1.056	0,01
KOLUMBIEN			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Ecopetrol S.A.			
5,875 % fällig am 28.05.2045 $	200	$ 137	0,00
STAATSEMISSIONEN			
Colombia Government International Bond			
5,000 % fällig am 15.06.2045	49.920	34.878	0,44
5,625 % fällig am 26.02.2044	3.100	2.316	0,03
		37.194	0,47
Summe Kolumbien		37.331	0,47
ZYPERN			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Atrium Finance PLC			
2,625 % fällig am 05.09.2027 €	19.800	15.749	0,20
DÄNEMARK			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
TDC Net A/S			
5,056 % fällig am 31.05.2028	12.000	12.870	0,16
DOMINIKANISCHE REPUBLIK			
STAATSEMISSIONEN			
Dominican Republic Government International Bond			
6,500 % fällig am 15.02.2048 $	40.600	35.183	0,44
ECUADOR			
STAATSEMISSIONEN			
Ecuador Government International Bond			
0,000 % fällig am 31.07.2030 (c)	20.689	6.018	0,08
1,500 % fällig am 31.07.2040	13.450	4.217	0,05
5,500 % fällig am 31.07.2030	12.800	6.223	0,08
Summe Ecuador		16.458	0,21
ÄGYPTEN			
STAATSEMISSIONEN			
Egypt Government International Bond			
5,625 % fällig am 16.04.2030 €	2.550	1.549	0,02
6,375 % fällig am 11.04.2031	17.600	10.718	0,14
7,500 % fällig am 16.02.2061 $	44.000	22.187	0,28
8,500 % fällig am 31.01.2047	9.500	5.072	0,06
Summe Ägypten		39.526	0,50
FINNLAND			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Balder Finland Oyj			
1,000 % fällig am 18.01.2027 €	200	165	0,00
1,000 % fällig am 20.01.2029	300	209	0,01
1,375 % fällig am 24.05.2030	4.900	3.199	0,04
2,000 % fällig am 18.01.2031	300	196	0,00
Summe Finnland		3.769	0,05
FRANKREICH			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Accor S.A.			
2,375 % fällig am 29.11.2028	1.100	1.080	0,01
Altarea S.C.A.			
1,750 % fällig am 16.01.2030	500	381	0,00
1,875 % fällig am 17.01.2028	600	530	0,01
Altareit S.C.A.			
2,875 % fällig am 02.07.2025	100	101	0,00
Altice France S.A.			
3,375 % fällig am 15.01.2028	3.100	2.477	0,03
4,000 % fällig am 15.07.2029 (h)	10.900	8.566	0,11
4,250 % fällig am 15.10.2029	20.100	15.835	0,20
5,500 % fällig am 15.01.2028 $	600	454	0,01
BNP Paribas S.A.			
1,904 % fällig am 30.09.2028	35.700	30.444	0,38
5,198 % fällig am 10.01.2030	4.000	3.870	0,05
CGG S.A.			
8,750 % fällig am 01.04.2027	6.700	5.619	0,07

BESCHREIBUNG		PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
Electricite de France S.A.				
4,500 % fällig am 21.09.2028	$	5.700	$ 5.445	0,07
6,900 % fällig am 23.05.2053		1.700	1.763	0,02
9,125 % fällig am 15.03.2033 (d)		2.000	2.056	0,03
La Mondiale SAM				
5,050 % fällig am 17.12.2025 (d)	€	12.665	13.576	0,17
Loxam S.A.S.				
2,875 % fällig am 15.04.2026		1.600	1.624	0,02
3,750 % fällig am 15.07.2026		1.900	1.969	0,03
4,500 % fällig am 15.02.2027 (h)		5.500	5.761	0,07
New Immo Holding S.A.				
2,750 % fällig am 26.11.2026		200	196	0,00
Renault S.A.				
2,375 % fällig am 25.05.2026		18.300	18.511	0,23
Societe Generale S.A.				
4,000 % fällig am 12.01.2027	$	700	653	0,01
7,375 % fällig am 04.10.2023 (d)(f)		400	389	0,01
7,875 % fällig am 18.12.2023 (d)(f)		2.600	2.550	0,03
TDF Infrastructure SASU				
1,750 % fällig am 01.12.2029	€	45.500	40.046	0,50
Ubisoft Entertainment S.A.				
0,878 % fällig am 24.11.2027		6.000	5.032	0,06
Verallia S.A.				
1,875 % fällig am 10.11.2031		8.100	7.123	0,09
			176.051	2,21
KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG				
Altice France S.A.				
8,677 % fällig am 15.08.2028		3.079	2.938	0,04
Summe Frankreich			178.989	2,25
DEUTSCHLAND				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Deutsche Bank AG				
3,035 % fällig am 28.05.2032 (g)	$	1.100	867	0,01
3,547 % fällig am 18.09.2031		19.350	16.081	0,20
3,729 % fällig am 14.01.2032 (g)		2.900	2.195	0,03
3,742 % fällig am 07.01.2033		1.900	1.395	0,02
5,882 % fällig am 08.07.2031		37.300	32.688	0,41
DVI Deutsche Vermögens- & Immobilienverwaltungs GmbH				
2,500 % fällig am 25.01.2027	€	1.200	994	0,01
Fraport AG Frankfurt Airport Services Worldwide				
1,625 % fällig am 09.07.2024		17.200	18.277	0,23
IHO Verwaltungs GmbH (3,750 % bar oder 4,500 % PIK)				
3,750 % fällig am 15.09.2026 (a)		19.950	20.362	0,26
INEOS Styrolution Group GmbH				
2,250 % fällig am 16.01.2027		19.000	17.812	0,22
Volkswagen Bank GmbH				
2,500 % fällig am 31.07.2026		15.800	16.333	0,20
ZF Finance GmbH				
2,750 % fällig am 25.05.2027		16.200	15.786	0,20
3,750 % fällig am 21.09.2028		32.000	31.501	0,40
			174.291	2,19
KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG				
SCUR-Alpha 1503 GmbH				
10,602 % fällig am 28.03.2030	$	2.494	2.366	0,03
Summe Deutschland			176.657	2,22
GHANA				
STAATSEMISSIONEN				
Ghana Government International Bond				
8,125 % fällig am 26.03.2032 ^		4.200	1.815	0,02
8,750 % fällig am 11.03.2061 ^		5.100	2.128	0,03
8,950 % fällig am 26.03.2051 ^		5.600	2.348	0,03
Summe Ghana			6.291	0,08
GUERNSEY, KANALINSELN				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Globalworth Real Estate Investments Ltd.				
2,950 % fällig am 29.07.2026	€	7.400	6.086	0,08
3,000 % fällig am 29.03.2025		16.606	14.992	0,19
Sirius Real Estate Ltd.				
1,125 % fällig am 22.06.2026		200	180	0,00
1,750 % fällig am 24.11.2028	€	500	$ 390	0,00
Summe Guernsey, Kanalinseln			21.648	0,27
HONGKONG				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Fortune Star BVI Ltd.				
3,950 % fällig am 02.10.2026		24.300	18.293	0,23
Huarong Finance Co. Ltd.				
2,125 % fällig am 30.09.2023	$	3.000	2.965	0,04
Summe Hongkong			21.258	0,27
INDONESIEN				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Pertamina Persero PT				
6,500 % fällig am 07.11.2048		33.400	34.777	0,44
Perusahaan Perseroan Persero PT Perusahaan Listrik Negara				
3,000 % fällig am 30.06.2030		17.600	15.071	0,19
6,150 % fällig am 21.05.2048		15.000	14.517	0,18
			64.365	0,81
STAATSEMISSIONEN				
Indonesia Government International Bond				
1,400 % fällig am 30.10.2031	€	4.630	4.022	0,05
4,850 % fällig am 11.01.2033	$	2.800	2.793	0,04
5,650 % fällig am 11.01.2053		1.100	1.154	0,01
			7.969	0,10
Summe Indonesien			72.334	0,91
INTERNATIONALE				
KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG				
Project Mercury				
TBD % fällig am 17.07.2030	€	8.000	8.728	0,11
IRLAND				
FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE				
Accunia European CLO DAC				
4,107 % fällig am 15.10.2030		714	774	0,01
Adagio CLO DAC				
3,897 % fällig am 15.10.2031		5.800	6.206	0,08
Ares European CLO				
3,837 % fällig am 15.10.2030		298	319	0,00
Ares European CLO DAC				
3,787 % fällig am 15.04.2030		1.672	1.789	0,02
3,837 % fällig am 15.10.2030		1.689	1.809	0,02
3,957 % fällig am 15.10.2031		9.900	10.616	0,13
4,050 % fällig am 20.04.2032		500	535	0,01
Armada Euro CLO DAC				
3,897 % fällig am 15.07.2031		11.095	11.842	0,15
Aurium CLO DAC				
3,907 % fällig am 16.01.2031		4.793	5.128	0,06
4,618 % fällig am 23.03.2032		10.400	11.176	0,14
Avoca CLO DAC				
3,997 % fällig am 15.10.2032		2.900	3.093	0,04
Bain Capital Euro CLO DAC				
3,940 % fällig am 20.01.2032		5.468	5.834	0,07
Black Diamond CLO DAC				
4,060 % fällig am 20.01.2032		2.092	2.250	0,03
4,303 % fällig am 15.05.2032		4.400	4.696	0,06
Blackrock European CLO DAC				
3,797 % fällig am 15.10.2031		10.900	11.620	0,15
BlueMountain Fuji EUR CLO DAC				
1,050 % fällig am 15.01.2031		994	1.000	0,01
3,897 % fällig am 15.01.2031		7.755	8.289	0,10
BNPP AM Euro CLO DAC				
3,777 % fällig am 15.04.2031		1.000	1.067	0,01
Bridgepoint CLO DAC				
4,387 % fällig am 15.01.2034		1.300	1.399	0,02
Cairn CLO DAC				
3,957 % fällig am 15.10.2031		8.600	9.197	0,12
Carlyle Euro CLO DAC				
3,877 % fällig am 15.01.2031		11.548	12.335	0,16
3,953 % fällig am 15.08.2030		4.392	4.684	0,06
4,213 % fällig am 15.08.2032		4.400	4.693	0,06
Carlyle Global Market Strategies Euro CLO Ltd.				
4,073 % fällig am 15.11.2031	€	7.450	$ 7.975	0,10
CVC Cordatus Loan Fund DAC				
3,827 % fällig am 15.10.2031		13.200	14.131	0,18
3,937 % fällig am 15.04.2032		1.366	1.466	0,02
4,008 % fällig am 27.01.2031		1.383	1.482	0,02
4,103 % fällig am 15.08.2032		2.387	2.555	0,03
Dryden Euro CLO DAC				
3,837 % fällig am 15.04.2033		12.800	13.661	0,17
4,183 % fällig am 15.05.2034		14.700	15.694	0,20
Euro-Galaxy CLO DAC				
3,765 % fällig am 11.04.2031		1.281	1.373	0,02
3,831 % fällig am 24.04.2034		9.600	10.199	0,13
GoldenTree Loan Management EUR CLO DAC				
4,100 % fällig am 20.01.2032		1.700	1.809	0,02
Griffith Park CLO DAC				
4,103 % fällig am 21.11.2031		31.400	33.611	0,42
Harvest CLO DAC				
1,040 % fällig am 15.07.2031		1.600	1.591	0,02
3,880 % fällig am 20.10.2031		18.800	20.093	0,25
3,937 % fällig am 15.07.2031		10.400	11.074	0,14
4,027 % fällig am 15.01.2032		17.600	18.790	0,24
4,250 % fällig am 26.06.2030		2.393	2.558	0,03
Invesco Euro CLO DAC				
3,827 % fällig am 15.07.2031		850	905	0,01
Jubilee CLO DAC				
3,777 % fällig am 15.04.2030		4.200	4.476	0,06
3,787 % fällig am 15.04.2030		1.900	2.031	0,03
3,827 % fällig am 15.04.2031		5.850	6.228	0,08
Laurelin DAC				
3,920 % fällig am 20.10.2031		10.900	11.677	0,15
Madison Park Euro Funding DAC				
3,927 % fällig am 15.01.2032		35.500	37.920	0,48
3,977 % fällig am 15.07.2032		5.600	5.959	0,08
Man GLG Euro CLO DAC				
3,987 % fällig am 15.10.2032		5.194	5.520	0,07
4,216 % fällig am 15.12.2031		10.690	11.451	0,14
Oak Hill European Credit Partners DAC				
3,930 % fällig am 20.01.2032		2.040	2.175	0,03
3,940 % fällig am 20.10.2031		15.200	16.150	0,20
OCP Euro CLO DAC				
3,997 % fällig am 15.01.2032		2.961	3.189	0,04
4,091 % fällig am 22.09.2034		12.700	13.495	0,17
OZLME DAC				
4,088 % fällig am 27.07.2032		1.999	2.127	0,03
Palmer Square European Loan Funding DAC				
3,957 % fällig am 15.04.2031		5.852	6.272	0,08
4,227 % fällig am 15.10.2031		4.751	5.106	0,06
Palmerston Park CLO DAC				
3,825 % fällig am 18.04.2030		994	1.070	0,01
Sculptor European CLO DAC				
3,916 % fällig am 14.01.2032		6.700	7.181	0,09
Segovia European CLO DAC				
4,080 % fällig am 20.07.2032		10.100	10.736	0,14
Tikehau CLO DAC				
4,144 % fällig am 04.08.2034		9.400	10.021	0,13
Toro European CLO DAC				
3,995 % fällig am 12.01.2032		2.500	2.675	0,03
4,097 % fällig am 15.07.2030		267	290	0,00
4,133 % fällig am 15.02.2034		7.650	8.123	0,10
			453.190	5,71
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
ABH Financial Ltd. Via Alfa Holding Issuance PLC				
2,700 % fällig am 11.06.2023 ^		26.550	4.345	0,05
AerCap Ireland Capital DAC				
3,150 % fällig am 15.02.2024	$	12.900	12.658	0,16
4,625 % fällig am 15.10.2027		34.750	32.958	0,42
Bank of Ireland Group PLC				
6,253 % fällig am 16.09.2026		10.600	10.534	0,13
SMBC Aviation Capital Finance DAC				
2,300 % fällig am 15.06.2028		900	767	0,01
			61.262	0,77
Summe Irland			514.452	6,48

BESCHREIBUNG		PAR (000S)		MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
ITALIEN					
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL					
Aeroporti di Roma SpA					
1,750 % fällig am 30.07.2031	€	3.400	$	3.013	0,04
Banca Monte dei Paschi di Siena SpA					
2,625 % fällig am 28.04.2025		34.235		35.064	0,44
3,625 % fällig am 24.09.2024		9.656		10.237	0,13
8,500 % fällig am 10.09.2030		20.780		20.520	0,26
Intesa Sanpaolo SpA					
3,250 % fällig am 23.09.2024	$	7.900		7.582	0,10
4,000 % fällig am 23.09.2029		10.276		8.936	0,11
5,148 % fällig am 10.06.2030	£	6.000		6.172	0,08
Mundys SpA					
1,625 % fällig am 03.02.2025	€	7.200		7.509	0,09
1,875 % fällig am 13.07.2027		3.000		2.903	0,04
1,875 % fällig am 12.02.2028		79.550		74.210	0,93
Nexi SpA					
2,125 % fällig am 30.04.2029 (h)		40.500		36.939	0,46
Societa per Azioni Esercizi Aeroportuali SEA SpA					
3,500 % fällig am 09.10.2025		100		104	0,00
UniCredit SpA					
1,982 % fällig am 03.06.2027	$	10.500		9.256	0,12
7,296 % fällig am 02.04.2034		6.901		6.507	0,08
7,830 % fällig am 04.12.2023		77.950		78.419	0,99
Summe Italien				307.371	3,87
ELFENBEINKÜSTE					
STAATSEMISSIONEN					
Ivory Coast Government International Bond					
5,750 % fällig am 31.12.2032		2.985		2.792	0,03
6,625 % fällig am 22.03.2048	€	10.400		8.079	0,10
6,875 % fällig am 17.10.2040		3.400		2.828	0,04
Summe Elfenbeinküste				13.699	0,17
JAPAN					
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL					
Nissan Motor Co. Ltd.					
4,345 % fällig am 17.09.2027	$	41.200		37.501	0,47
4,810 % fällig am 17.09.2030		4.700		4.126	0,05
Summe Japan				41.627	0,52
JERSEY, KANALINSELN					
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL					
AA Bond Co. Ltd.					
5,500 % fällig am 31.07.2050	£	21.190		23.501	0,30
7,375 % fällig am 31.07.2050		7.300		8.406	0,10
Adient Global Holdings Ltd.					
3,500 % fällig am 15.08.2024	€	687		737	0,01
Corsair International Ltd.					
7,772 % fällig am 28.01.2027		18.800		20.408	0,26
8,122 % fällig am 28.01.2029		8.200		8.879	0,11
G City Europe Ltd.					
4,250 % fällig am 11.09.2025		19.820		18.919	0,24
Kennedy Wilson Europe Real Estate Ltd.					
3,250 % fällig am 12.11.2025		900		871	0,01
Summe Jersey, Kanalinseln				81.721	1,03
JORDANIEN					
STAATSEMISSIONEN					
Jordan Government International Bond					
7,500 % fällig am 13.01.2029	$	4.000		4.032	0,05
KASACHSTAN					
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL					
KazMunayGas National Co. JSC					
6,375 % fällig am 24.10.2048		6.000		5.143	0,07
LIBERIA					
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL					
Royal Caribbean Cruises Ltd.					
7,250 % fällig am 15.01.2030		1.300		1.318	0,02

BESCHREIBUNG		AKTIEN		MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
LUXEMBURG					
STAMMAKTIEN					
DrillCo Holding Lux S.A. (b)		25	$	1	0,00
DrillCo Holding Lux S.A. (b)(g)		443.430		8.513	0,11
Intelsat Emergence S.A. (b)(g)		184.122		4.235	0,05
Summe Stammaktien				12.749	0,16
		PAR (000S)			
WANDELANLEIHEN & WECHSEL					
Corestate Capital Holding S.A.					
1,375 % fällig am 31.07.2023 ^	€	14.700		2.334	0,03
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL					
Albion Financing SARL					
5,250 % fällig am 15.10.2026		15.600		16.064	0,20
6,125 % fällig am 15.10.2026	$	5.500		5.175	0,07
Altice Financing S.A.					
5,750 % fällig am 15.08.2029		52.300		40.569	0,51
Altice France Holding S.A.					
6,000 % fällig am 15.02.2028		23.300		11.387	0,14
Aroundtown S.A.					
5,375 % fällig am 21.03.2029		17.900		13.263	0,17
Constellation Oil Services Holding S.A. (3,000 % bar und 4,000 % PIK)					
3,000 % fällig am 31.12.2026 (a)		765		453	0,01
Corestate Capital Holding S.A.					
3,500 % fällig am 31.07.2023 ^	€	33.100		5.101	0,06
CPI Property Group S.A.					
1,500 % fällig am 27.01.2031		8.900		5.295	0,07
1,625 % fällig am 23.04.2027		6.500		5.183	0,07
1,750 % fällig am 14.01.2030		10.300		6.821	0,09
2,750 % fällig am 22.01.2028	£	3.200		2.725	0,03
Cromwell Ereit Lux Finco SARL					
2,125 % fällig am 19.11.2025	€	600		565	0,01
FORESEA Holding S.A.					
7,500 % fällig am 15.06.2030	$	4.579		4.006	0,05
Gazprom PJSC Via Gaz Capital S.A.					
4,250 % fällig am 06.04.2024 ^	£	15.900		17.880	0,22
Greensaif Pipelines Bidco SARL					
6,129 % fällig am 23.02.2038	$	2.900		2.966	0,04
6,510 % fällig am 23.02.2042		4.700		4.891	0,06
Intelsat Jackson Holdings S.A.					
6,500 % fällig am 15.03.2030		13.710		12.515	0,16
Logicor Financing SARL					
0,750 % fällig am 15.07.2024	€	1.100		1.144	0,01
3,250 % fällig am 13.11.2028		13.900		12.985	0,16
Petrorio Luxembourg Trading SARL					
6,125 % fällig am 09.06.2026	$	3.700		3.558	0,04
Sberbank of Russia Via SB Capital S.A.					
5,125 % fällig am 29.10.2022 ^		3.900		234	0,00
Summer BC Holdco SARL					
5,750 % fällig am 31.10.2026	€	17.700		17.223	0,22
Tierra Mojada Luxembourg SARL					
5,750 % fällig am 01.12.2040	$	45.333		38.826	0,49
				228.829	2,88
KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG					
Albion Financing SARL					
7,792 % fällig am 17.08.2026	€	6.946		7.569	0,10
Intelsat Jackson Holdings S.A.					
9,443 % fällig am 01.02.2029		3.386		3.377	0,04
				10.946	0,14
		AKTIEN			
RECHTE					
Intelsat Jackson Holdings S.A. - Exp. 05.12.2025		38.562		231	0,00
Summe Luxemburg				255.089	3,21

BESCHREIBUNG		AKTIEN		MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
MAZEDONIEN					
STAATSEMISSIONEN					
North Macedonia Government International Bond					
2,750 % fällig am 18.01.2025	€	1.600	$	1.666	0,02
3,675 % fällig am 03.06.2026		5.200		5.316	0,07
Summe Mazedonien				6.982	0,09
		AKTIEN			
MEXIKO					
STAMMAKTIEN					
Hipotecaria Su Casita S.A. (b)		28.925		0	0,00
Urbi Desarrollos Urbanos S.A.B. de C.V. (b)		477		0	0,00
Summe Stammaktien				0	0,00
		PAR (000S)			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL					
Petroleos Mexicanos					
5,625 % fällig am 23.01.2046	$	11.142		6.408	0,08
6,350 % fällig am 12.02.2048		3.800		2.302	0,03
6,625 % fällig am 15.06.2035		76.800		53.624	0,67
6,625 % fällig am 15.06.2038		3.900		2.608	0,03
6,700 % fällig am 16.02.2032		63.187		48.100	0,61
6,750 % fällig am 21.09.2047		20.900		13.143	0,17
7,690 % fällig am 23.01.2050		8.400		5.701	0,07
				131.886	1,66
STAATSEMISSIONEN					
Mexico Government International Bond					
3,771 % fällig am 24.05.2061		6.700		4.572	0,06
5,750 % fällig am 12.10.2110		10.000		8.949	0,11
6,350 % fällig am 09.02.2035		15.300		16.123	0,20
				29.644	0,37
Summe Mexiko				161.530	2,03
MULTINATIONAL					
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL					
Allied Universal Holdco LLC					
3,625 % fällig am 01.06.2028	€	18.800		16.478	0,21
Connect Finco SARL					
6,750 % fällig am 01.10.2026	$	13.400		13.028	0,16
Summe multinational				29.506	0,37
NIEDERLANDE					
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL					
ASR Nederland NV					
7,000 % fällig am 07.12.2043	€	1.400		1.593	0,02
Athora Netherlands NV					
7,000 % fällig am 19.06.2025 (d)(f)		4.300		4.440	0,06
Citycon Treasury BV					
1,625 % fällig am 12.03.2028		3.400		2.711	0,03
CTP NV					
0,500 % fällig am 21.06.2025		1.200		1.167	0,02
1,250 % fällig am 21.06.2029		200		158	0,00
1,500 % fällig am 27.09.2031		1.500		1.142	0,01
Enel Finance International NV					
5,000 % fällig am 15.06.2032	$	5.000		4.730	0,06
Imperial Brands Finance Netherlands BV					
1,750 % fällig am 18.03.2033	€	28.800		22.768	0,29
ING Groep NV					
5,750 % fällig am 16.11.2026 (d)(f)	$	9.000		7.956	0,10
6,500 % fällig am 16.04.2025 (d)(f)		18.702		17.470	0,22
6,750 % fällig am 16.04.2024 (d)(f)		14.280		13.655	0,17
NE Property BV					
3,375 % fällig am 14.07.2027 (h)	€	25.250		24.755	0,31
NN Group NV					
4,500 % fällig am 15.01.2026 (d)		17.900		18.918	0,24
Q-Park Holding BV					
3,500 % fällig am 01.02.2025		33.350		34.064	0,43
Syngenta Finance NV					
3,375 % fällig am 16.04.2026		20.000		20.953	0,26
4,892 % fällig am 24.04.2025	$	32.895		32.219	0,41
Teva Pharmaceutical Finance Netherlands BV					
4,375 % fällig am 09.05.2030	€	100		93	0,00

BESCHREIBUNG		PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
4,500 % fällig am 01.03.2025	€	1.808	$ 1.955	0,03
United Group BV				
3,625 % fällig am 15.02.2028		1.600	1.389	0,02
5,250 % fällig am 01.02.2030		8.600	7.447	0,09
Volkswagen International Finance NV				
3,500 % fällig am 17.06.2025 (d)		10.100	10.365	0,13
			229.948	2,90
KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG				
WP/AP Telecom Holdings BV				
7,498 % fällig am 30.03.2029		39.000	42.068	0,53
NON-AGENCY-MBS				
EMF-NL Prime BV				
3,977 % fällig am 17.04.2041		21	22	0,00
Eurosail BV				
4,677 % fällig am 17.10.2040		99	108	0,00
			130	0,00
Summe Niederlande			272.146	3,43
NIGERIA				
STAATSEMISSIONEN				
Nigeria Government International Bond				
7,143 % fällig am 23.02.2030	$	8.200	6.895	0,09
7,625 % fällig am 28.11.2047		17.700	12.634	0,16
7,875 % fällig am 16.02.2032		23.600	19.851	0,25
Summe Nigeria			39.380	0,50
OMAN				
STAATSEMISSIONEN				
Oman Government International Bond				
6,750 % fällig am 17.01.2048		29.300	28.224	0,36
PANAMA				
STAATSEMISSIONEN				
Panama Government International Bond				
6,700 % fällig am 26.01.2036		20.600	22.109	0,28
PERU				
STAATSEMISSIONEN				
Peru Government International Bond				
8,750 % fällig am 21.11.2033		15.000	19.062	0,24
PHILIPPINEN				
STAATSEMISSIONEN				
Philippines Government International Bond				
5,000 % fällig am 17.07.2033		2.000	2.028	0,03
PORTUGAL				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Banco Espirito Santo S.A.				
4,750 % fällig am 15.01.2018 ^	€	200	53	0,00
Galp Energia SGPS S.A.				
2,000 % fällig am 15.01.2026		12.300	12.600	0,16
Summe Portugal			12.653	0,16
KATAR				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Nakilat, Inc.				
6,067 % fällig am 31.12.2033	$	9.944	10.438	0,13
RUMÄNIEN				
STAATSEMISSIONEN				
Romania Government International Bond				
2,000 % fällig am 14.04.2033	€	1.500	1.159	0,01
2,875 % fällig am 13.04.2042		8.000	5.379	0,07
6,625 % fällig am 27.09.2029		14.500	16.467	0,21
7,625 % fällig am 17.01.2053	$	3.000	3.305	0,04
Summe Rumänien			26.310	0,33
RUSSLAND				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
ALROSA Finance S.A.				
3,100 % fällig am 25.06.2027 ^		22.400	1.344	0,01

BESCHREIBUNG		PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
4,650 % fällig am 09.04.2024 ^	$	3.200	$ 192	0,00
MMK International Capital DAC				
4,375 % fällig am 13.06.2024 ^		8.600	516	0,01
			2.052	0,02
STAATSEMISSIONEN				
Russia Government International Bond				
2,875 % fällig am 04.12.2025 ^	€	7.700	4.893	0,06
4,250 % fällig am 23.06.2027 ^	$	13.800	6.011	0,08
4,750 % fällig am 27.05.2026 ^		200	101	0,00
5,250 % fällig am 23.06.2047 ^		3.200	1.424	0,02
5,250 % fällig am 23.06.2047 ^		28.000	1.680	0,02
			14.109	0,18
Summe Russland			16.161	0,20
SAUDI-ARABIEN				
STAATSEMISSIONEN				
Saudi Arabia Government International Bond				
3,450 % fällig am 02.02.2061		34.500	24.328	0,31
4,875 % fällig am 18.07.2033		20.000	20.004	0,25
5,000 % fällig am 18.01.2053		20.000	18.555	0,23
Summe Saudi-Arabien			62.887	0,79
SERBIEN				
STAATSEMISSIONEN				
Serbia Government International Bond				
1,650 % fällig am 03.03.2033	€	8.900	6.480	0,08
6,500 % fällig am 26.09.2033	$	9.400	9.242	0,12
Summe Serbien			15.722	0,20
SINGAPUR				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Flex Ltd.				
3,750 % fällig am 01.02.2026		14.000	13.315	0,17
SLOWENIEN				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Nova Kreditna Banka Maribor d.d.				
1,875 % fällig am 27.01.2025	€	8.300	8.759	0,11
Nova Ljubljanska Banka d.d.				
3,400 % fällig am 05.02.2030		7.100	6.584	0,08
Summe Slowenien			15.343	0,19
SÜDAFRIKA				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
AngloGold Ashanti Holdings PLC				
3,750 % fällig am 01.10.2030	$	2.000	1.718	0,03
Sasol Financing USA LLC				
5,875 % fällig am 27.03.2024		4.100	4.051	0,05
			5.769	0,08
STAATSEMISSIONEN				
South Africa Government International Bond				
5,650 % fällig am 27.09.2047		13.700	9.725	0,12
Summe Südafrika			15.494	0,20
SPANIEN				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
ACS Actividades de Construccion y Servicios S.A.				
1,375 % fällig am 17.06.2025 (h)	€	700	716	0,01
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A.				
6,000 % fällig am 29.03.2024 (d)(f)		2.800	2.963	0,04
6,000 % fällig am 15.01.2026 (d)(f)		9.200	9.443	0,12
6,138 % fällig am 14.09.2028	$	15.800	15.850	0,20
Banco de Sabadell S.A.				
5,375 % fällig am 08.09.2026	€	22.100	23.999	0,30
Banco Santander S.A.				
3,490 % fällig am 28.05.2030	$	1.400	1.222	0,01
Cellnex Finance Co. S.A.				
2,000 % fällig am 15.09.2032	€	23.100	19.882	0,25
Lorca Telecom Bondco S.A.				
4,000 % fällig am 18.09.2027		1.900	1.896	0,02
			75.971	0,95

BESCHREIBUNG		PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG				
Grifols S.A.				
5,633 % fällig am 15.11.2027	€	1.296	$ 1.393	0,02
Summe Spanien			77.364	0,97
SRI LANKA				
STAATSEMISSIONEN				
Sri Lanka Government International Bond				
7,550 % fällig am 28.03.2030 ^	$	16.800	7.735	0,10
7,850 % fällig am 14.03.2029 ^		5.800	2.670	0,03
Summe Sri Lanka			10.405	0,13
SCHWEDEN				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Castellum AB				
0,750 % fällig am 04.09.2026	€	200	180	0,00
Sagax AB				
2,000 % fällig am 17.01.2024		119	127	0,00
2,250 % fällig am 13.03.2025		400	412	0,01
Volvo Car AB				
4,250 % fällig am 31.05.2028 (h)		29.900	31.394	0,39
Summe Schweden			32.113	0,40
SCHWEIZ				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Credit Suisse AG				
6,500 % fällig am 08.08.2023 (f)	$	57.800	57.590	0,73
UBS Group AG				
3,869 % fällig am 12.01.2029		300	271	0,00
4,125 % fällig am 15.04.2026		15.100	14.410	0,18
4,194 % fällig am 01.04.2031		1.400	1.247	0,02
4,703 % fällig am 05.08.2027		1.200	1.147	0,01
6,442 % fällig am 11.08.2028		3.200	3.214	0,04
6,537 % fällig am 12.08.2033		500	513	0,01
Summe Schweiz			78.392	0,99
TÜRKEI				
STAATSEMISSIONEN				
Turkey Government International Bond				
4,875 % fällig am 16.04.2043		33.067	21.308	0,27
5,750 % fällig am 11.05.2047		58.300	39.985	0,50
Summe Türkei			61.293	0,77
UKRAINE				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
NPC Ukrenergo				
6,875 % fällig am 09.11.2028 ^		1.000	215	0,00
STAATSEMISSIONEN				
State Agency of Roads of Ukraine				
6,250 % fällig am 24.06.2030 ^		1.400	307	0,00
Ukraine Government International Bond				
4,375 % fällig am 27.01.2032 ^	€	67.619	16.121	0,20
6,750 % fällig am 20.06.2028 ^		6.300	1.477	0,02
6,876 % fällig am 21.05.2031 ^	$	6.400	1.478	0,02
7,375 % fällig am 25.09.2034 ^		5.300	1.244	0,02
8,994 % fällig am 01.02.2026 ^		8.200	2.075	0,03
			22.702	0,29
Summe Ukraine			22.917	0,29
VEREINIGTE ARABISCHE EMIRATE				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
DAE Sukuk Difc Ltd.				
3,750 % fällig am 15.02.2026		11.800	11.230	0,14
GROSSBRITANNIEN				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
AGPS BondCo PLC				
4,625 % fällig am 14.01.2026 ^	€	1.100	468	0,01
5,500 % fällig am 13.11.2026 ^		2.000	837	0,01
Barclays PLC				
0,577 % fällig am 09.08.2029		2.500	2.186	0,03
6,125 % fällig am 15.12.2025 (d)(f)	$	11.100	9.743	0,12
7,437 % fällig am 02.11.2033		8.500	9.201	0,12

BESCHREIBUNG		PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
7,750 % fällig am 15.09.2023 (d)(f)	$	3.500	$ 3.438	0,04
BAT International Finance PLC				
3,950 % fällig am 15.06.2025		1.600	1.541	0,02
Bellis Acquisition Co. PLC				
3,250 % fällig am 16.02.2026	£	32.400	34.575	0,43
Greene King Finance PLC				
5,106 % fällig am 15.03.2034		355	398	0,01
HSBC Holdings PLC				
2,848 % fällig am 04.06.2031	$	4.200	3.487	0,04
3,973 % fällig am 22.05.2030		9.300	8.360	0,10
4,950 % fällig am 31.03.2030		2.500	2.464	0,03
Informa PLC				
1,250 % fällig am 22.04.2028	€	7.500	7.109	0,09
John Lewis PLC				
4,250 % fällig am 18.12.2034	£	3.210	2.546	0,03
6,125 % fällig am 21.01.2025		5.600	6.859	0,09
Lendlease Europe Finance PLC				
3,500 % fällig am 02.12.2033		368	306	0,00
Lloyds Banking Group PLC				
4,976 % fällig am 11.08.2033	$	1.300	1.217	0,02
Market Bidco Finco PLC				
4,750 % fällig am 04.11.2027	€	19.800	17.444	0,22
Marks & Spencer PLC				
3,750 % fällig am 19.05.2026	£	100	115	0,00
4,500 % fällig am 10.07.2027		10.138	11.417	0,14
Mitchells & Butlers Finance PLC				
5,451 % fällig am 15.12.2030		3.433	4.048	0,05
6,002 % fällig am 15.12.2030	$	1.384	1.274	0,02
6,013 % fällig am 15.12.2030	£	349	398	0,01
6,469 % fällig am 15.09.2032		1.700	1.885	0,02
Nationwide Building Society				
4,363 % fällig am 01.08.2024	$	30.500	30.439	0,38
5,750 % fällig am 20.06.2027 (d)(f)	£	4.300	4.695	0,06
NatWest Group PLC				
4,800 % fällig am 05.04.2026	$	31.275	30.379	0,38
4,892 % fällig am 18.05.2029		17.200	16.380	0,21
6,000 % fällig am 29.12.2025 (d)(f)		17.800	16.509	0,21
Pinnacle Bidco PLC				
5,500 % fällig am 15.02.2025	€	900	946	0,01
6,375 % fällig am 15.02.2025	£	2.200	2.671	0,03
Rolls-Royce PLC				
5,750 % fällig am 15.10.2027		3.300	3.901	0,05
Santander UK Group Holdings PLC				
3,823 % fällig am 03.11.2028	$	18.124	16.330	0,21
6,750 % fällig am 24.06.2024 (d)(f)	£	11.835	14.114	0,18
Tesco Property Finance PLC				
5,744 % fällig am 13.04.2040		1.955	2.308	0,03
TP ICAP Finance PLC				
5,250 % fällig am 29.05.2026		5.182	6.070	0,08
Travis Perkins PLC				
4,500 % fällig am 07.09.2023		2.100	2.648	0,03
Virgin Media Secured Finance PLC				
4,125 % fällig am 15.08.2030		27.700	27.318	0,34
4,250 % fällig am 15.01.2030		24.600	24.688	0,31
Virgin Money UK PLC				
2,875 % fällig am 24.06.2025	€	21.500	22.733	0,29
3,125 % fällig am 22.06.2025	£	500	603	0,01
3,375 % fällig am 24.04.2026		1.400	1.621	0,02
4,000 % fällig am 25.09.2026		4.200	4.829	0,06
4,000 % fällig am 03.09.2027		4.700	5.231	0,07
Vmed O2 UK Financing PLC				
3,250 % fällig am 31.01.2031	€	7.450	6.696	0,08
4,000 % fällig am 31.01.2029	£	38.700	39.201	0,49
4,500 % fällig am 15.07.2031		9.100	8.808	0,11
			420.434	5,29
KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG				
INEOS Finance PLC				
6,168 % fällig am 08.11.2028	€	14.200	15.034	0,19
INEOS Quattro Holdings Ltd.				
6,168 % fällig am 29.01.2026		4.900	5.175	0,07
			20.209	0,26
Summe Großbritannien			440.643	5,55

BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
USA			
FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE			
Accredited Mortgage Loan Trust			
4,800 % fällig am 25.01.2035	$ 317	$ 286	0,00
5,410 % fällig am 25.09.2036	578	568	0,01
5,870 % fällig am 25.09.2035	1.127	1.105	0,01
6,095 % fällig am 25.09.2035	7.750	6.267	0,08
ACE Securities Corp. Home Equity Loan Trust			
5,330 % fällig am 25.02.2037	3.010	1.306	0,02
5,360 % fällig am 25.02.2037	3.036	1.342	0,02
5,450 % fällig am 25.04.2036	251	242	0,00
5,450 % fällig am 25.07.2036 ^	11.297	3.154	0,04
5,460 % fällig am 25.08.2036	518	491	0,01
5,470 % fällig am 25.08.2036 ^	2.349	598	0,01
5,750 % fällig am 25.02.2036	447	438	0,01
5,810 % fällig am 25.11.2035	231	232	0,00
5,945 % fällig am 25.01.2035	604	552	0,01
6,050 % fällig am 25.12.2034	1.053	944	0,01
6,080 % fällig am 25.02.2036 ^	69	62	0,00
6,125 % fällig am 25.06.2034	446	408	0,01
Aegis Asset-Backed Securities Trust			
5,795 % fällig am 25.12.2035	188	169	0,00
6,150 % fällig am 25.03.2035 ^	213	198	0,00
Ameriquest Mortgage Securities Trust			
5,735 % fällig am 25.03.2036	1	1	0,00
Ameriquest Mortgage Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates			
4,039 % fällig am 25.11.2034	165	164	0,00
6,020 % fällig am 25.07.2034	108	107	0,00
6,080 % fällig am 25.05.2035	482	473	0,01
6,155 % fällig am 25.07.2035	3.500	2.924	0,04
6,170 % fällig am 25.09.2034	798	774	0,01
6,170 % fällig am 25.10.2034	92	91	0,00
6,200 % fällig am 25.11.2034	315	309	0,00
6,260 % fällig am 25.03.2035	200	195	0,00
Amortizing Residential Collateral Trust			
6,150 % fällig am 25.10.2034	85	84	0,00
Argent Securities Trust			
5,690 % fällig am 25.05.2036	794	197	0,00
Asset-Backed Funding Certificates Trust			
5,260 % fällig am 25.01.2037	178	103	0,00
5,310 % fällig am 25.01.2037	619	359	0,01
5,370 % fällig am 25.01.2037	206	120	0,00
6,200 % fällig am 25.03.2034 ^	251	234	0,00
6,400 % fällig am 25.06.2037	11.869	8.260	0,10
Asset-Backed Securities Corp. Home Equity Loan Trust			
6,110 % fällig am 25.07.2035	16	16	0,00
Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust			
4,477 % fällig am 25.11.2035 ^	30	28	0,00
6,155 % fällig am 25.06.2035	504	483	0,01
6,350 % fällig am 25.01.2045	39	39	0,00
6,400 % fällig am 25.08.2037	320	314	0,00
Carrington Mortgage Loan Trust			
5,310 % fällig am 25.10.2036	720	565	0,01
5,370 % fällig am 25.01.2037	1.200	887	0,01
5,400 % fällig am 25.10.2036	720	565	0,01
5,410 % fällig am 25.02.2037	2.219	2.008	0,03
5,630 % fällig am 25.06.2036	1.969	1.866	0,02
Chase Funding Trust			
6,333 % fällig am 25.04.2032	72	69	0,00
Citigroup Mortgage Loan Trust			
5,310 % fällig am 25.01.2037	731	248	0,00
5,350 % fällig am 25.05.2037	802	529	0,01
5,470 % fällig am 25.09.2036	598	437	0,01
5,550 % fällig am 25.11.2046	622	596	0,01
5,570 % fällig am 25.12.2036	1.375	1.343	0,02
Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.			
5,410 % fällig am 25.03.2037	981	830	0,01
5,885 % fällig am 25.09.2035 ^	148	147	0,00
Countrywide Asset-Backed Certificates			
5,650 % fällig am 25.01.2046 ^	7.016	6.552	0,08
6,050 % fällig am 25.03.2047 ^	54	45	0,00
6,250 % fällig am 25.05.2047 ^	796	604	0,01
Countrywide Asset-Backed Certificates Trust			
4,473 % fällig am 25.07.2036	1.375	1.229	0,02
4,473 % fällig am 25.07.2036	33	30	0,00
4,740 % fällig am 25.10.2035	0	0	0,00
5,290 % fällig am 25.07.2037 ^	487	479	0,01
5,370 % fällig am 25.06.2037	955	915	0,01

BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
5,370 % fällig am 25.09.2037 ^	$ 73	$ 73	0,00
5,380 % fällig am 25.10.2047	1.052	1.032	0,01
5,450 % fällig am 25.03.2047 ^	773	755	0,01
5,460 % fällig am 25.09.2037 ^	653	539	0,01
5,630 % fällig am 25.02.2037 ^	3.600	3.207	0,04
5,675 % fällig am 25.08.2036	4.600	4.383	0,06
5,750 % fällig am 25.06.2036	83	82	0,00
5,840 % fällig am 25.05.2036	268	263	0,00
5,850 % fällig am 25.03.2036 ^	1.386	1.197	0,02
5,990 % fällig am 25.10.2047	3.720	3.535	0,05
6,140 % fällig am 25.02.2036 ^	10.608	9.235	0,12
6,245 % fällig am 25.07.2035	104	103	0,00
6,725 % fällig am 25.11.2034	796	780	0,01
Countrywide Asset-Backed Certificates Trust, Inc.			
5,870 % fällig am 25.07.2034	34	34	0,00
6,005 % fällig am 25.08.2034	83	82	0,00
Countrywide Asset-Backed Certificates, Inc.			
5,710 % fällig am 25.04.2034	16	14	0,00
5,900 % fällig am 25.03.2034	21	20	0,00
5,950 % fällig am 25.08.2047	38	37	0,00
6,650 % fällig am 25.02.2035	125	122	0,00
Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp.			
4,599 % fällig am 25.01.2032	18	17	0,00
Credit-Based Asset Servicing & Securitization LLC			
5,370 % fällig am 25.07.2037	180	119	0,00
Credit-Based Asset Servicing & Securitization Trust			
3,075 % fällig am 25.07.2036	3.738	3.483	0,04
Ellington Loan Acquisition Trust			
6,200 % fällig am 25.05.2037	2.055	1.933	0,02
EMC Mortgage Loan Trust			
6,250 % fällig am 25.11.2041	3	2	0,00
First Franklin Mortgage Loan Trust			
5,470 % fällig am 25.04.2036	120	115	0,00
5,630 % fällig am 25.04.2036	400	357	0,01
5,630 % fällig am 25.08.2036	147	135	0,00
5,870 % fällig am 25.10.2035	10	10	0,00
6,095 % fällig am 25.03.2035	50	49	0,00
6,350 % fällig am 25.01.2035	77	76	0,00
6,575 % fällig am 25.10.2034	189	188	0,00
7,025 % fällig am 25.07.2034	904	889	0,01
First NLC Trust			
2,294 % fällig am 25.05.2035	182	153	0,00
Fremont Home Loan Trust			
5,490 % fällig am 25.02.2036	1.764	1.669	0,02
5,490 % fällig am 25.02.2037	1.084	372	0,01
6,080 % fällig am 25.06.2035 ^	3.077	2.726	0,03
GSAA Home Equity Trust			
5,270 % fällig am 25.11.2036	409	103	0,00
5,390 % fällig am 25.04.2047	72	67	0,00
6,050 % fällig am 25.08.2037	45	44	0,00
GSAMP Trust			
3,332 % fällig am 25.11.2034	351	331	0,00
5,200 % fällig am 25.12.2046	234	118	0,00
5,240 % fällig am 25.01.2037	270	158	0,00
5,290 % fällig am 25.12.2036	5.763	3.118	0,04
5,690 % fällig am 25.04.2036	2.908	1.831	0,02
5,735 % fällig am 25.01.2036	99	101	0,00
Home Equity Loan Trust			
5,490 % fällig am 25.04.2037	2.000	1.651	0,02
Home Equity Mortgage Loan Asset-Backed Trust			
5,290 % fällig am 25.11.2036	294	264	0,00
5,390 % fällig am 25.04.2037	789	515	0,01
5,530 % fällig am 25.06.2036	70	68	0,00
HSI Asset Securitization Corp. Trust			
5,370 % fällig am 25.12.2036	495	135	0,00
5,430 % fällig am 25.01.2037	2.927	2.036	0,03
5,650 % fällig am 25.07.2036	2.482	1.119	0,01
JPMorgan Mortgage Acquisition Trust			
4,459 % fällig am 25.01.2037 ^	485	266	0,00
5,340 % fällig am 25.03.2047	502	496	0,01
5,390 % fällig am 25.08.2036	294	288	0,00
5,410 % fällig am 25.03.2037	117	114	0,00
5,410 % fällig am 25.06.2037	99	98	0,00
5,430 % fällig am 25.01.2037	101	101	0,00
5,450 % fällig am 25.03.2037	4.349	3.907	0,05
5,555 % fällig am 25.07.2036	150	145	0,00
Lehman ABS Mortgage Loan Trust			
5,240 % fällig am 25.06.2037	247	159	0,00
5,350 % fällig am 25.06.2037	126	82	0,00

BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
Long Beach Mortgage Loan Trust			
5,330 % fällig am 25.09.2036	$ 14.143	$ 3.971	0,05
5,690 % fällig am 25.05.2046	2.494	797	0,01
5,750 % fällig am 25.02.2036	11.316	9.307	0,12
5,795 % fällig am 25.11.2035	38	38	0,00
6,200 % fällig am 25.06.2035	258	250	0,00
6,425 % fällig am 25.02.2035	1.928	1.860	0,02
MASTR Asset-Backed Securities Trust			
5,320 % fällig am 25.10.2036	3	2	0,00
5,350 % fällig am 25.08.2036	4.991	1.584	0,02
5,370 % fällig am 25.08.2036	1.922	753	0,01
5,420 % fällig am 25.08.2036	3.334	1.359	0,02
5,450 % fällig am 25.03.2036	1.041	928	0,01
5,510 % fällig am 25.02.2036	329	134	0,00
5,630 % fällig am 25.03.2036	1.017	625	0,01
5,650 % fällig am 25.10.2035 ^	288	269	0,00
5,930 % fällig am 25.02.2034	453	436	0,01
6,050 % fällig am 25.04.2034	316	299	0,00
6,050 % fällig am 25.10.2035	1.325	1.152	0,02
MASTR Specialized Loan Trust			
6,275 % fällig am 25.11.2035	139	129	0,00
Merrill Lynch Mortgage Investors Trust			
5,450 % fällig am 25.08.2037	2.723	1.415	0,02
5,610 % fällig am 25.11.2037	2.823	999	0,01
5,870 % fällig am 25.05.2036	61	60	0,00
6,050 % fällig am 25.02.2047	105	62	0,00
6,200 % fällig am 25.04.2035	93	87	0,00
Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust			
5,220 % fällig am 25.10.2036	66	29	0,00
5,280 % fällig am 25.11.2036	307	139	0,00
5,280 % fällig am 25.01.2037	883	405	0,01
5,290 % fällig am 25.10.2036	1.928	839	0,01
5,290 % fällig am 25.11.2036	192	91	0,00
5,290 % fällig am 25.05.2037	3.314	2.381	0,03
5,300 % fällig am 25.10.2036	173	91	0,00
5,300 % fällig am 25.11.2036	2.917	1.606	0,02
5,350 % fällig am 25.09.2036	3	1	0,00
5,370 % fällig am 25.11.2036	240	114	0,00
5,400 % fällig am 25.03.2037	910	402	0,01
5,470 % fällig am 25.09.2036	1.173	525	0,01
5,730 % fällig am 25.01.2035	686	681	0,01
5,770 % fällig am 25.12.2035	132	126	0,00
5,795 % fällig am 25.09.2035	6	6	0,00
5,855 % fällig am 25.12.2034	82	74	0,00
5,855 % fällig am 25.01.2035	1.380	1.300	0,02
6,005 % fällig am 25.03.2034	371	364	0,01
6,020 % fällig am 25.09.2035	4.281	3.505	0,04
6,140 % fällig am 25.06.2035	961	939	0,01
6,400 % fällig am 25.07.2037	400	335	0,00
7,050 % fällig am 25.02.2047	723	605	0,01
Morgan Stanley Capital, Inc. Trust			
5,510 % fällig am 25.03.2036	96	77	0,00
Morgan Stanley Dean Witter Capital, Inc. Trust			
6,500 % fällig am 25.02.2033	227	225	0,00
6,725 % fällig am 25.11.2032	30	29	0,00
Morgan Stanley Home Equity Loan Trust			
5,250 % fällig am 25.12.2036	1.436	697	0,01
5,380 % fällig am 25.04.2037	2.390	1.255	0,02
5,470 % fällig am 25.04.2036	67	47	0,00
5,500 % fällig am 25.04.2037	16.321	8.582	0,11
Morgan Stanley Mortgage Loan Trust			
6,000 % fällig am 25.02.2037 ^	54	31	0,00
6,000 % fällig am 25.04.2037	10.055	3.681	0,05
6,869 % fällig am 25.11.2036 ^	223	84	0,00
New Century Home Equity Loan Trust			
5,510 % fällig am 25.05.2036	7	7	0,00
5,870 % fällig am 25.03.2035	167	160	0,00
Nomura Home Equity Loan, Inc. Home Equity Loan Trust			
5,765 % fällig am 25.02.2036	2	2	0,00
NovaStar Mortgage Funding Trust			
5,250 % fällig am 25.03.2037	866	308	0,00
5,300 % fällig am 25.03.2037	1.085	386	0,01
5,310 % fällig am 25.09.2037	1.001	990	0,01
5,350 % fällig am 25.01.2037	1.022	358	0,01
5,570 % fällig am 25.01.2037	1.219	427	0,01
7,025 % fällig am 25.03.2035	583	573	0,01
Option One Mortgage Loan Trust			
5,290 % fällig am 25.01.2037	154	88	0,00
5,320 % fällig am 25.05.2037	130	71	0,00
5,330 % fällig am 25.04.2037	454	228	0,00
5,400 % fällig am 25.07.2037	$ 2.344	$ 1.507	0,02
5,430 % fällig am 25.07.2036	13.743	7.942	0,10
5,690 % fällig am 25.01.2036	400	357	0,01
5,720 % fällig am 25.01.2036	5.043	3.519	0,04
5,915 % fällig am 25.08.2035	400	378	0,01
Option One Mortgage Loan Trust Asset-Backed Certificates			
5,840 % fällig am 25.11.2035	421	395	0,01
Ownit Mortgage Loan Trust			
6,050 % fällig am 25.10.2036 ^	126	118	0,00
Park Place Securities, Inc.			
5,885 % fällig am 25.09.2035	183	178	0,00
Park Place Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates			
5,885 % fällig am 25.08.2035	355	341	0,00
5,885 % fällig am 25.09.2035	5.817	5.596	0,07
5,945 % fällig am 25.07.2035	94	93	0,00
5,975 % fällig am 25.07.2035	400	374	0,01
6,095 % fällig am 25.06.2035	20	20	0,00
6,200 % fällig am 25.10.2034	282	276	0,00
6,275 % fällig am 25.03.2035	255	246	0,00
6,395 % fällig am 25.01.2036	78	76	0,00
6,950 % fällig am 25.12.2034	406	399	0,01
People's Choice Home Loan Securities Trust			
6,500 % fällig am 25.01.2035	487	462	0,01
People's Financial Realty Mortgage Securities Trust			
5,290 % fällig am 25.09.2036	989	276	0,00
Popular ABS Mortgage Pass-Through Trust			
5,360 % fällig am 25.01.2037	369	356	0,00
5,410 % fällig am 25.11.2036	17	17	0,00
5,735 % fällig am 25.02.2036	63	62	0,00
RAAC Trust			
5,750 % fällig am 25.06.2044	52	43	0,00
5,750 % fällig am 25.09.2045	83	80	0,00
5,850 % fällig am 25.11.2046	159	148	0,00
6,350 % fällig am 25.10.2045	14	14	0,00
6,650 % fällig am 25.09.2047	396	378	0,01
Renaissance Home Equity Loan Trust			
5,340 % fällig am 25.01.2037	1.247	438	0,01
Residential Asset Mortgage Products Trust			
5,790 % fällig am 25.01.2036	423	378	0,01
Residential Asset Securities Corp. Trust			
5,410 % fällig am 25.11.2036	243	223	0,00
5,490 % fällig am 25.11.2036	66	62	0,00
5,710 % fällig am 25.04.2036	28	27	0,00
5,750 % fällig am 25.02.2036	130	127	0,00
5,780 % fällig am 25.12.2035	67	66	0,00
5,810 % fällig am 25.11.2035	25	25	0,00
5,810 % fällig am 25.12.2035	149	132	0,00
5,990 % fällig am 25.12.2034	5	5	0,00
Saxon Asset Securities Trust			
5,450 % fällig am 25.05.2047	6.331	4.465	0,06
5,615 % fällig am 25.03.2036	1.560	1.487	0,02
Securitized Asset-Backed Receivables LLC Trust			
5,330 % fällig am 25.07.2036	246	86	0,00
5,430 % fällig am 25.07.2036	707	571	0,01
5,650 % fällig am 25.03.2036	1.244	780	0,01
5,650 % fällig am 25.05.2036	254	137	0,00
5,690 % fällig am 25.03.2036	110	96	0,00
5,810 % fällig am 25.08.2035 ^	111	85	0,00
SG Mortgage Securities Trust			
5,360 % fällig am 25.10.2036	1.500	1.039	0,01
Soundview Home Loan Trust			
5,270 % fällig am 25.11.2036	33	10	0,00
5,615 % fällig am 25.06.2036 ^	15.486	12.724	0,16
5,630 % fällig am 25.07.2036	200	171	0,00
Specialty Underwriting & Residential Finance Trust			
3,700 % fällig am 25.02.2037 ^	485	189	0,00
5,420 % fällig am 25.04.2037	122	85	0,00
5,450 % fällig am 25.11.2037	649	361	0,01
Structured Asset Investment Loan Trust			
5,300 % fällig am 25.06.2036	22	21	0,00
5,300 % fällig am 25.09.2036	109	105	0,00
5,750 % fällig am 25.01.2036	91	88	0,00
5,825 % fällig am 25.11.2035	7.073	6.032	0,08
5,915 % fällig am 25.08.2035	4.237	4.017	0,05
6,050 % fällig am 25.09.2034	46	45	0,00
6,080 % fällig am 25.01.2035	252	243	0,00
6,275 % fällig am 25.07.2033	20	20	0,00
6,530 % fällig am 25.04.2033	11	10	0,00
Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust			
5,280 % fällig am 25.02.2037	$ 9	$ 8	0,00
5,380 % fällig am 25.01.2037	2.066	1.250	0,02
5,490 % fällig am 25.12.2036	79	74	0,00
5,490 % fällig am 25.12.2036	111	108	0,00
5,570 % fällig am 25.02.2037	143	138	0,00
6,050 % fällig am 25.08.2037	36	36	0,00
Structured Asset Securities Corp. Trust			
5,840 % fällig am 25.09.2035	166	157	0,00
Truman Capital Mortgage Loan Trust			
5,410 % fällig am 25.03.2036	374	369	0,01
WaMu Asset-Backed Certificates WaMu Trust			
5,300 % fällig am 25.01.2037	889	733	0,01
Washington Mutual Asset-Backed Certificates Trust			
5,630 % fällig am 25.05.2036	658	500	0,01
Wells Fargo Home Equity Asset-Backed Securities Trust			
5,645 % fällig am 25.05.2036	1.966	1.954	0,03
Wells Fargo Home Equity Trust Mortgage Pass-Through Certificates			
5,890 % fällig am 25.04.2034	150	144	0,00
		231.534	2,92

	AKTIEN		
STAMMAKTIEN			
ENERGIE			
Constellation Oil Services Holding S.A. 'B' (b)(g)	844.339	92	0,00

	PAR (000S)		
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Alaska Airlines Pass-Through Trust			
4,800 % fällig am 15.02.2029	$ 2.492	2.398	0,03
Ally Financial, Inc.			
8,000 % fällig am 01.11.2031	12.575	13.056	0,16
American Airlines Pass-Through Trust			
3,000 % fällig am 15.04.2030	209	186	0,00
3,150 % fällig am 15.08.2033	3.045	2.659	0,03
3,200 % fällig am 15.12.2029	3.694	3.315	0,04
3,350 % fällig am 15.04.2031	2.699	2.402	0,03
3,375 % fällig am 01.11.2028	3.783	3.397	0,04
3,575 % fällig am 15.07.2029	2.210	2.051	0,03
3,650 % fällig am 15.12.2029	4.182	3.600	0,05
3,650 % fällig am 15.08.2030	4.260	3.929	0,05
3,700 % fällig am 01.04.2028	3.531	3.179	0,04
American Tower Corp.			
2,950 % fällig am 15.01.2051	10.000	6.318	0,08
Amgen, Inc.			
5,250 % fällig am 02.03.2033	5.000	5.009	0,06
5,750 % fällig am 02.03.2063	2.800	2.843	0,04
Antares Holdings LP			
2,750 % fällig am 15.01.2027	2.700	2.221	0,03
AT&T, Inc.			
3,800 % fällig am 01.12.2057	12.200	8.843	0,11
Aviation Capital Group LLC			
4,375 % fällig am 30.01.2024	800	787	0,01
4,875 % fällig am 01.10.2025	600	573	0,01
5,500 % fällig am 15.12.2024	8.900	8.716	0,11
BAT Capital Corp.			
3,557 % fällig am 15.08.2027	1.300	1.196	0,02
Boeing Co.			
3,950 % fällig am 01.08.2059	1.500	1.109	0,01
5,930 % fällig am 01.05.2060	10.000	9.912	0,13
British Airways Pass-Through Trust			
2,900 % fällig am 15.09.2036	1.241	1.026	0,01
4,250 % fällig am 15.05.2034	2.386	2.181	0,03
Broadcom, Inc.			
2,450 % fällig am 15.02.2031	8.900	7.242	0,09
3,187 % fällig am 15.11.2036	2.600	1.966	0,03
4,926 % fällig am 15.05.2037	1.242	1.125	0,01
Centene Corp.			
3,000 % fällig am 15.10.2030	5.000	4.171	0,05
4,625 % fällig am 15.12.2029	3.500	3.225	0,04
Charter Communications Operating LLC			
3,850 % fällig am 01.04.2061	11.300	6.844	0,09
4,200 % fällig am 15.03.2028	4.300	4.033	0,05
5,375 % fällig am 01.04.2038	3.800	3.240	0,04

Aufstellung des Wertpapierbestands des Diversified Income Fund (Forts.)

BESCHREIBUNG		PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
Chesapeake Energy Corp.				
5,500 % fällig am 01.02.2026	$	1.500	$ 1.464	0,02
Citigroup, Inc.				
2,572 % fällig am 03.06.2031 (g)		6.900	5.760	0,07
Cloud Software Group, Inc.				
6,500 % fällig am 31.03.2029		4.000	3.565	0,05
CommScope, Inc.				
4,750 % fällig am 01.09.2029		64.100	50.598	0,64
Community Health Systems, Inc.				
8,000 % fällig am 15.03.2026		4.300	4.193	0,05
Coty, Inc.				
3,875 % fällig am 15.04.2026 (h)	€	16.400	17.387	0,22
Credit Suisse AG AT1 Claim ^	$	10.400	416	0,01
Crown Castle, Inc.				
2,100 % fällig am 01.04.2031		6.500	5.206	0,07
2,250 % fällig am 15.01.2031		4.000	3.264	0,04
2,500 % fällig am 15.07.2031		5.000	4.112	0,05
5,000 % fällig am 11.01.2028		6.500	6.386	0,08
CVS Health Corp.				
3,250 % fällig am 15.08.2029		330	297	0,00
DAE Funding LLC				
1,550 % fällig am 01.08.2024		15.800	15.004	0,19
1,625 % fällig am 15.02.2024		13.500	13.017	0,16
2,625 % fällig am 20.03.2025		7.700	7.249	0,09
3,375 % fällig am 20.03.2028		8.700	7.850	0,10
Dell International LLC				
8,100 % fällig am 15.07.2036		2.337	2.736	0,03
DISH DBS Corp.				
5,750 % fällig am 01.12.2028		27.800	20.729	0,26
Edison International				
5,750 % fällig am 15.06.2027		100	100	0,00
El Paso Natural Gas Co. LLC				
8,375 % fällig am 15.06.2032		1.000	1.148	0,01
Elevance Health, Inc.				
4,750 % fällig am 15.02.2033		2.400	2.332	0,03
Energy Transfer LP				
4,950 % fällig am 15.05.2028		14.763	14.294	0,18
5,950 % fällig am 01.10.2043		200	187	0,00
6,050 % fällig am 01.06.2041		3.811	3.664	0,05
6,100 % fällig am 15.02.2042		800	758	0,01
6,500 % fällig am 01.02.2042		7.140	7.241	0,09
6,625 % fällig am 15.10.2036		800	821	0,01
7,500 % fällig am 01.07.2038		12.865	14.123	0,18
EQT Corp.				
6,125 % fällig am 01.02.2025		28.205	28.072	0,35
Fidelity National Financial, Inc.				
3,400 % fällig am 15.06.2030		200	175	0,00
Ford Motor Credit Co. LLC				
1,744 % fällig am 19.07.2024	€	3.900	4.119	0,05
2,330 % fällig am 25.11.2025		13.400	13.742	0,17
2,386 % fällig am 17.02.2026		4.200	4.307	0,05
2,700 % fällig am 10.08.2026	$	13.600	12.155	0,15
2,748 % fällig am 14.06.2024	£	9.700	11.803	0,15
3,021 % fällig am 06.03.2024	€	13.400	14.445	0,18
3,250 % fällig am 15.09.2025		4.000	4.197	0,05
3,625 % fällig am 17.06.2031	$	26.300	21.584	0,27
3,815 % fällig am 02.11.2027		1.200	1.074	0,01
4,053 % fällig am 15.11.2023	€	1.100	1.199	0,02
4,125 % fällig am 17.08.2027	$	6.100	5.576	0,07
4,174 % fällig am 01.12.2024	€	21.600	23.283	0,29
4,271 % fällig am 09.01.2027	$	1.700	1.575	0,02
4,389 % fällig am 08.01.2026		1.800	1.705	0,02
4,535 % fällig am 06.03.2025	£	2.800	3.385	0,04
4,542 % fällig am 01.08.2026	$	1.900	1.788	0,02
5,125 % fällig am 16.06.2025		1.525	1.484	0,02
5,584 % fällig am 18.03.2024		7.800	7.752	0,10
Fortress Transportation & Infrastructure Investors LLC				
5,500 % fällig am 01.05.2028		19.600	17.956	0,23
6,500 % fällig am 01.10.2025		13.461	13.273	0,17
Freedom Mortgage Corp.				
6,625 % fällig am 15.01.2027		13.100	11.354	0,14
7,625 % fällig am 01.05.2026		23.900	22.029	0,28
General Motors Co.				
6,800 % fällig am 01.10.2027 (g)		700	728	0,01
Genesis Energy LP				
8,875 % fällig am 15.04.2030		1.400	1.369	0,02
Global Atlantic Fin Co.				
4,400 % fällig am 15.10.2029	$	11.620	$ 9.812	0,12
GLP Capital LP				
5,750 % fällig am 01.06.2028		3.700	3.623	0,05
Gray Oak Pipeline LLC				
3,450 % fällig am 15.10.2027		6.900	6.173	0,08
HCA, Inc.				
3,500 % fällig am 15.07.2051		5.000	3.464	0,04
5,500 % fällig am 01.06.2033		1.600	1.598	0,02
5,900 % fällig am 01.06.2053		1.775	1.760	0,02
IQVIA, Inc.				
5,700 % fällig am 15.05.2028		2.000	1.982	0,03
JetBlue Pass-Through Trust				
2,750 % fällig am 15.11.2033		841	717	0,01
4,000 % fällig am 15.05.2034		9.535	8.709	0,11
Kennedy-Wilson, Inc.				
4,750 % fällig am 01.02.2030		24.300	18.349	0,23
Las Vegas Sands Corp.				
3,200 % fällig am 08.08.2024		5.610	5.437	0,07
3,500 % fällig am 18.08.2026		6.500	6.058	0,08
3,900 % fällig am 08.08.2029		3.100	2.770	0,04
Marriott International, Inc.				
4,625 % fällig am 15.06.2030		900	862	0,01
Mattel, Inc.				
3,375 % fällig am 01.04.2026		1.800	1.658	0,02
McAfee Corp.				
7,375 % fällig am 15.02.2030		2.000	1.741	0,02
Medline Borrower LP				
3,875 % fällig am 01.04.2029		6.000	5.220	0,07
5,250 % fällig am 01.10.2029		6.000	5.212	0,07
Midwest Connector Capital Co. LLC				
3,900 % fällig am 01.04.2024		1.300	1.273	0,02
Netflix, Inc.				
4,875 % fällig am 15.06.2030		21.000	20.685	0,26
NGPL PipeCo LLC				
7,768 % fällig am 15.12.2037		21.356	22.833	0,29
Noble Finance LLC				
8,000 % fällig am 15.04.2030		3.000	3.053	0,04
NuStar Logistics LP				
5,625 % fällig am 28.04.2027		20.400	19.621	0,25
Occidental Petroleum Corp.				
6,625 % fällig am 01.09.2030		20.900	21.736	0,27
Omega Healthcare Investors, Inc.				
4,750 % fällig am 15.01.2028		200	183	0,00
OneMain Finance Corp.				
6,125 % fällig am 15.03.2024		9.600	9.576	0,12
6,875 % fällig am 15.03.2025		11.800	11.694	0,15
7,125 % fällig am 15.03.2026		3.458	3.401	0,04
Organon & Co.				
2,875 % fällig am 30.04.2028	€	41.400	39.314	0,50
Pacific Gas & Electric Co.				
2,100 % fällig am 01.08.2027	$	300	256	0,00
2,500 % fällig am 01.02.2031		1.300	1.019	0,01
3,150 % fällig am 01.01.2026		8.400	7.799	0,10
3,300 % fällig am 15.03.2027 ^		3.100	2.816	0,04
3,300 % fällig am 01.12.2027 ^		2.900	2.545	0,03
3,300 % fällig am 01.08.2040		25.900	17.484	0,22
3,400 % fällig am 15.08.2024 ^		1.900	1.839	0,02
3,450 % fällig am 01.07.2025		2.250	2.125	0,03
3,500 % fällig am 15.06.2025 ^		2.000	1.894	0,02
3,750 % fällig am 01.07.2028		2.350	2.108	0,03
3,950 % fällig am 01.12.2047 ^		800	546	0,01
4,200 % fällig am 01.06.2041		1.100	821	0,01
4,250 % fällig am 15.03.2046 ^		2.000	1.425	0,02
4,450 % fällig am 15.04.2042 ^		3.500	2.654	0,03
4,500 % fällig am 01.07.2040		9.396	7.317	0,09
4,550 % fällig am 01.07.2030		6.000	5.435	0,07
4,600 % fällig am 15.06.2043 ^		3.600	2.728	0,03
4,650 % fällig am 01.08.2028		100	93	0,00
Piper Sandler Cos.				
5,200 % fällig am 15.10.2023		4.300	4.289	0,05
Plains All American Pipeline LP				
5,150 % fällig am 01.06.2042		12.177	10.126	0,13
6,650 % fällig am 15.01.2037		6.790	6.836	0,09
Rio Oil Finance Trust				
9,250 % fällig am 06.07.2024		8.854	8.940	0,11
9,750 % fällig am 06.01.2027		1.500	1.549	0,02
RLJ Lodging Trust LP				
3,750 % fällig am 01.07.2026	$	1.600	$ 1.469	0,02
Rockies Express Pipeline LLC				
3,600 % fällig am 15.05.2025		100	95	0,00
4,800 % fällig am 15.05.2030		14.400	12.598	0,16
4,950 % fällig am 15.07.2029		5.000	4.580	0,06
Sabine Pass Liquefaction LLC				
5,625 % fällig am 01.03.2025		40.625	40.483	0,51
Santander Holdings USA, Inc.				
3,450 % fällig am 02.06.2025		7.900	7.453	0,09
Sirius XM Radio, Inc.				
4,125 % fällig am 01.07.2030		3.000	2.452	0,03
Spirit AeroSystems, Inc.				
9,375 % fällig am 30.11.2029		900	965	0,01
Spirit Airlines Pass-Through Trust				
4,100 % fällig am 01.10.2029		294	266	0,00
Sprint Capital Corp.				
8,750 % fällig am 15.03.2032		12.000	14.517	0,18
Sprint LLC				
7,625 % fällig am 01.03.2026		1.125	1.170	0,02
Standard Industries, Inc.				
2,250 % fällig am 21.11.2026	€	37.000	35.952	0,45
4,750 % fällig am 15.01.2028	$	3.450	3.216	0,04
Synchrony Financial				
5,150 % fällig am 19.03.2029		300	273	0,00
T-Mobile USA, Inc.				
4,950 % fällig am 15.03.2028		1.000	985	0,01
5,650 % fällig am 15.01.2053		2.000	2.032	0,03
Tallgrass Energy Partners LP				
5,500 % fällig am 15.01.2028		3.400	3.112	0,04
6,000 % fällig am 31.12.2030		7.450	6.573	0,08
Tennessee Gas Pipeline Co. LLC				
8,375 % fällig am 15.06.2032		1.351	1.545	0,02
Time Warner Cable LLC				
4,500 % fällig am 15.09.2042		1.200	898	0,01
6,750 % fällig am 15.06.2039		1.700	1.635	0,02
Toll Brothers Finance Corp.				
4,875 % fällig am 15.03.2027		9.600	9.304	0,12
U.S. Airways Pass-Through Trust				
3,950 % fällig am 15.05.2027		1.973	1.842	0,02
United Airlines Pass-Through Trust				
2,700 % fällig am 01.11.2033		945	794	0,01
2,900 % fällig am 01.11.2029		2.219	1.929	0,02
3,100 % fällig am 07.01.2030		710	643	0,01
3,450 % fällig am 01.06.2029		794	729	0,01
3,450 % fällig am 07.01.2030		1.420	1.229	0,02
3,500 % fällig am 01.09.2031		1.212	1.095	0,01
4,000 % fällig am 11.10.2027		562	529	0,01
4,150 % fällig am 11.10.2025		1.903	1.871	0,02
4,150 % fällig am 25.02.2033		300	276	0,00
5,875 % fällig am 15.04.2029		28.029	27.823	0,35
Venture Global Calcasieu Pass LLC				
6,250 % fällig am 15.01.2030		8.800	8.737	0,11
Venture Global LNG, Inc.				
8,125 % fällig am 01.06.2028		18.775	19.090	0,24
8,375 % fällig am 01.06.2031		21.725	21.932	0,28
Verizon Communications, Inc.				
2,355 % fällig am 15.03.2032		26.800	21.564	0,27
VICI Properties LP				
3,500 % fällig am 15.02.2025		3.200	3.060	0,04
VMware, Inc.				
4,700 % fällig am 15.05.2030		3.900	3.724	0,05
Wells Fargo & Co.				
1,741 % fällig am 04.05.2030	€	5.800	5.415	0,07
WMG Acquisition Corp.				
3,000 % fällig am 15.02.2031	$	5.000	4.049	0,05
Wynn Las Vegas LLC				
5,250 % fällig am 15.05.2027		700	664	0,01
Wynn Resorts Finance LLC				
5,125 % fällig am 01.10.2029		9.400	8.435	0,11
XPO, Inc.				
6,250 % fällig am 01.06.2028		5.000	4.926	0,06
Zayo Group Holdings, Inc.				
4,000 % fällig am 01.03.2027		2.265	1.602	0,02
			1.191.471	15,00

BESCHREIBUNG		PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG				
Avolon TLB Borrower (U.S.) LLC				
7,396 % fällig am 01.12.2027	$	28.435	$ 28.433	0,36
CenturyLink, Inc.				
7,467 % fällig am 15.03.2027		35.060	27.150	0,34
Charter Communications Operating LLC				
6,795 % - 6,834 % fällig am 01.02.2027		48.472	48.240	0,61
CommScope, Inc.				
8,443 % fällig am 06.04.2026		770	739	0,01
Hilton Domestic Operating Co., Inc.				
6,939 % fällig am 22.06.2026		0	0	0,00
INEOS Styrolution U.S. Holding LLC				
7,967 % fällig am 29.01.2026		9.272	9.264	0,12
Level 3 Financing, Inc.				
6,967 % fällig am 01.03.2027		17.978	16.792	0,21
Marriott Ownership Resorts, Inc.				
6,943 % fällig am 29.08.2025		871	871	0,01
Standard Industries, Inc.				
7,692 % fällig am 22.09.2028		11.255	11.263	0,14
Summer (BC) Holdco SARL				
7,712 % fällig am 04.12.2026	€	5.000	5.155	0,06
Zayo Group Holdings, Inc.				
8,217 % fällig am 09.03.2027	$	600	473	0,01
			148.380	1,87
KOMMUNALANLEIHEN UND WECHSEL				
Massachusetts Port Authority Revenue Bonds, Series 2011				
6,202 % fällig am 01.07.2031		465	478	0,01
NON-AGENCY-MBS				
Adjustable Rate Mortgage Trust				
3,285 % fällig am 25.01.2036 ^		60	54	0,00
4,184 % fällig am 25.02.2036 ^		80	57	0,00
American Home Mortgage Assets Trust				
5,530 % fällig am 25.09.2046 ^		486	415	0,01
6,750 % fällig am 25.06.2037 ^		104	88	0,00
American Home Mortgage Investment Trust				
7,369 % fällig am 25.12.2035		703	252	0,01
Angel Oak Mortgage Trust				
1,469 % fällig am 25.06.2065		200	185	0,00
Banc of America Alternative Loan Trust				
6,000 % fällig am 25.06.2046 ^		95	84	0,00
6,000 % fällig am 25.07.2046 ^		96	81	0,00
Banc of America Funding Trust				
3,616 % fällig am 20.09.2035 ^		86	68	0,00
3,720 % fällig am 20.09.2047 ^		83	69	0,00
4,416 % fällig am 20.01.2047 ^		232	215	0,00
5,577 % fällig am 20.04.2047 ^		253	200	0,00
5,730 % fällig am 25.07.2037		241	221	0,00
5,750 % fällig am 25.03.2036		78	60	0,00
5,950 % fällig am 25.05.2037 ^		59	51	0,00
Banc of America Mortgage Trust				
3,896 % fällig am 25.02.2036 ^		2	2	0,00
4,153 % fällig am 25.01.2035		27	26	0,00
4,370 % fällig am 25.07.2035 ^		6	6	0,00
6,000 % fällig am 25.10.2036 ^		27	22	0,00
BCAP LLC Trust				
3,143 % fällig am 26.05.2037		4.315	3.877	0,05
5,590 % fällig am 25.05.2047 ^		184	176	0,00
6,250 % fällig am 26.08.2036		1.928	897	0,01
6,450 % fällig am 25.09.2047		53	46	0,00
Bear Stearns Adjustable Rate Mortgage Trust				
3,605 % fällig am 25.05.2034		19	16	0,00
4,033 % fällig am 25.01.2035		2	2	0,00
4,042 % fällig am 25.03.2035		25	23	0,00
4,060 % fällig am 25.06.2047 ^		91	82	0,00
4,216 % fällig am 25.01.2035		97	90	0,00
4,222 % fällig am 25.07.2036 ^		19	17	0,00
4,524 % fällig am 25.02.2036 ^		31	28	0,00
4,582 % fällig am 25.06.2035 ^		1	1	0,00
4,586 % fällig am 25.10.2035		24	23	0,00
5,137 % fällig am 25.07.2034		17	16	0,00
6,662 % fällig am 25.12.2046 ^		61	49	0,00
Bear Stearns ALT-A Trust				
3,781 % fällig am 25.11.2036		240	136	0,00
4,004 % fällig am 25.05.2036 ^		353	176	0,00
4,009 % fällig am 25.03.2036	$	282	$ 169	0,00
4,116 % fällig am 25.08.2036 ^		245	128	0,00
4,202 % fällig am 25.09.2035 ^		65	40	0,00
5,470 % fällig am 25.01.2047 ^		133	107	0,00
5,590 % fällig am 25.04.2036 ^		72	61	0,00
6,125 % fällig am 25.07.2035		8.500	7.693	0,10
Bear Stearns Structured Products, Inc. Trust				
4,098 % fällig am 26.01.2036 ^		83	67	0,00
Chase Mortgage Finance Trust				
3,814 % fällig am 25.01.2036 ^		205	176	0,00
3,962 % fällig am 25.03.2037 ^		194	180	0,00
4,086 % fällig am 25.03.2037 ^		45	42	0,00
5,750 % fällig am 25.02.2037		45	13	0,00
6,000 % fällig am 25.11.2036 ^		57	25	0,00
6,000 % fällig am 25.03.2037 ^		113	61	0,00
ChaseFlex Trust				
5,750 % fällig am 25.07.2037		143	118	0,00
6,300 % fällig am 25.06.2036 ^		55	47	0,00
Citicorp Mortgage Securities Trust				
6,000 % fällig am 25.09.2037		29	27	0,00
Citigroup Mortgage Loan Trust				
3,018 % fällig am 25.09.2037		23	23	0,00
3,620 % fällig am 25.10.2046 ^		60	54	0,00
3,857 % fällig am 25.03.2037 ^		2.893	2.502	0,03
3,904 % fällig am 25.09.2037 ^		131	114	0,00
3,974 % fällig am 25.09.2037 ^		69	61	0,00
4,132 % fällig am 25.07.2046 ^		166	151	0,00
4,321 % fällig am 25.03.2034		3	3	0,00
Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.				
4,183 % fällig am 25.02.2034		15	15	0,00
6,080 % fällig am 25.09.2035		8	8	0,00
CitiMortgage Alternative Loan Trust				
6,000 % fällig am 25.01.2037 ^		43	38	0,00
6,000 % fällig am 25.06.2037 ^		526	455	0,01
Countrywide Alternative Loan Resecuritization Trust				
6,000 % fällig am 25.05.2036 ^		220	131	0,00
Countrywide Alternative Loan Trust				
2,748 % fällig am 25.02.2036		279	212	0,00
4,048 % fällig am 20.11.2035		274	255	0,00
4,295 % fällig am 25.05.2036		166	147	0,00
5,250 % fällig am 25.06.2035 ^		226	175	0,00
5,337 % fällig am 20.02.2047 ^		160	125	0,00
5,347 % fällig am 20.09.2046		128	126	0,00
5,367 % fällig am 20.07.2046 ^		61	49	0,00
5,430 % fällig am 25.08.2037		340	298	0,01
5,430 % fällig am 25.04.2047		4.062	3.619	0,05
5,456 % fällig am 25.01.2036		344	321	0,01
5,500 % fällig am 25.02.2035		896	819	0,01
5,500 % fällig am 25.11.2035 ^		362	212	0,00
5,500 % fällig am 25.11.2035		1.349	809	0,01
5,500 % fällig am 25.12.2035 ^		521	341	0,01
5,500 % fällig am 25.05.2036 ^		307	126	0,00
5,500 % fällig am 25.08.2036 ^		55	25	0,00
5,510 % fällig am 25.11.2036		31	35	0,00
5,530 % fällig am 25.07.2046 ^		33	32	0,00
5,530 % fällig am 25.09.2046 ^		187	175	0,00
5,577 % fällig am 20.03.2046		81	66	0,00
5,577 % fällig am 20.05.2046 ^		1.346	1.142	0,02
5,630 % fällig am 25.12.2046 ^		2.521	1.605	0,02
5,650 % fällig am 25.06.2035		74	66	0,00
5,650 % fällig am 25.04.2036		3.172	1.195	0,02
5,670 % fällig am 25.07.2035		57	50	0,00
5,750 % fällig am 25.01.2035		183	174	0,00
5,750 % fällig am 25.07.2037		342	208	0,00
5,770 % fällig am 25.08.2035 ^		78	70	0,00
6,000 % fällig am 25.03.2035 ^		4.231	2.043	0,03
6,000 % fällig am 25.02.2036 ^		140	72	0,00
6,000 % fällig am 25.03.2036 ^		342	158	0,00
6,000 % fällig am 25.08.2036 ^		154	93	0,00
6,000 % fällig am 25.08.2036 ^		10	6	0,00
6,000 % fällig am 25.08.2036 ^		45	27	0,00
6,000 % fällig am 25.01.2037 ^		521	423	0,01
6,000 % fällig am 25.02.2037 ^		1.993	851	0,01
6,000 % fällig am 25.03.2037 ^		491	197	0,00
6,000 % fällig am 25.04.2037 ^		1.466	727	0,01
6,000 % fällig am 25.05.2037 ^		196	95	0,00
6,000 % fällig am 25.06.2037 ^		203	98	0,00
6,000 % fällig am 25.08.2037 ^		41	21	0,00
6,000 % fällig am 25.02.2047 ^		310	158	0,00
6,250 % fällig am 25.12.2036 ^		240	113	0,00
6,500 % fällig am 25.08.2032		13	12	0,00
6,500 % fällig am 25.09.2037 ^	$	9.108	$ 3.744	0,05
6,500 % fällig am 25.11.2037 ^		807	401	0,01
Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust				
2,948 % fällig am 20.10.2035		3	3	0,00
3,287 % fällig am 25.09.2037 ^		36	33	0,00
3,367 % fällig am 25.10.2035 ^		217	173	0,00
3,611 % fällig am 25.09.2047 ^		4	3	0,00
4,006 % fällig am 20.12.2035		20	17	0,00
4,085 % fällig am 25.03.2037 ^		45	40	0,00
4,123 % fällig am 20.11.2035 ^		80	66	0,00
4,936 % fällig am 25.04.2046 ^		747	238	0,00
5,500 % fällig am 25.10.2034		384	370	0,01
5,500 % fällig am 25.09.2035 ^		115	105	0,00
5,500 % fällig am 25.10.2035		47	27	0,00
5,650 % fällig am 25.03.2036		87	71	0,00
5,690 % fällig am 25.04.2046		7.068	2.057	0,03
5,830 % fällig am 25.03.2035 ^		45	40	0,00
6,000 % fällig am 25.05.2036 ^		120	57	0,00
6,000 % fällig am 25.02.2037 ^		494	357	0,01
6,000 % fällig am 25.03.2037 ^		31	14	0,00
6,000 % fällig am 25.09.2037 ^		26	14	0,00
6,250 % fällig am 25.09.2036 ^		618	246	0,00
6,500 % fällig am 25.11.2036 ^		164	63	0,00
Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp.				
4,311 % fällig am 25.06.2033		10	9	0,00
6,000 % fällig am 25.01.2036 ^		199	112	0,00
6,500 % fällig am 25.04.2033		0	0	0,00
Credit Suisse Mortgage Capital Certificates				
3,616 % fällig am 27.09.2035		1.449	1.229	0,02
3,906 % fällig am 28.04.2037		157	145	0,00
Credit Suisse Mortgage Capital Mortgage-Backed Trust				
6,000 % fällig am 25.07.2036		731	385	0,01
6,000 % fällig am 25.04.2037 ^		165	65	0,00
6,500 % fällig am 25.02.2022 ^		616	75	0,00
6,750 % fällig am 25.08.2036 ^		611	333	0,01
7,000 % fällig am 25.08.2037 ^		608	388	0,01
Credit Suisse Mortgage Capital Trust				
3,631 % fällig am 25.10.2043		837	784	0,01
Deutsche ALT-A Securities Mortgage Loan Trust				
5,530 % fällig am 25.08.2047		93	83	0,00
Deutsche ALT-A Securities, Inc. Mortgage Loan Trust				
5,650 % fällig am 25.02.2035		2.715	2.585	0,03
Deutsche Mortgage & Asset Receiving Corp.				
3,746 % fällig am 27.11.2036		59	59	0,00
First Horizon Alternative Mortgage Securities Trust				
5,549 % fällig am 25.06.2036 ^		39	31	0,00
6,250 % fällig am 25.08.2037 ^		63	27	0,00
First Horizon Mortgage Pass-Through Trust				
4,267 % fällig am 25.09.2035		279	263	0,01
GreenPoint Mortgage Funding Trust				
5,550 % fällig am 25.10.2046 ^		176	159	0,00
5,690 % fällig am 25.04.2036 ^		82	78	0,00
GSR Mortgage Loan Trust				
3,575 % fällig am 25.03.2047 ^		259	169	0,00
3,914 % fällig am 25.04.2035		16	14	0,00
3,935 % fällig am 25.01.2036 ^		11	11	0,00
4,481 % fällig am 25.11.2035		41	40	0,00
4,662 % fällig am 25.09.2035		19	19	0,00
4,662 % fällig am 25.09.2035		13	13	0,00
5,490 % fällig am 25.12.2034		5	4	0,00
5,750 % fällig am 25.02.2036		147	127	0,00
5,750 % fällig am 25.03.2036 ^		35	32	0,00
5,750 % fällig am 25.01.2037 ^		92	57	0,00
6,000 % fällig am 25.02.2036 ^		356	183	0,00
6,500 % fällig am 25.09.2036 ^		253	126	0,00
6,970 % fällig am 25.04.2032		25	21	0,00
HarborView Mortgage Loan Trust				
4,063 % fällig am 19.06.2036 ^		170	77	0,00
4,226 % fällig am 19.08.2036 ^		42	33	0,00
4,227 % fällig am 19.07.2035 ^		2	2	0,00
4,688 % fällig am 19.08.2036 ^		1	1	0,00
5,637 % fällig am 19.06.2035		219	209	0,00
5,697 % fällig am 19.03.2035		20	20	0,00
5,777 % fällig am 19.11.2035		96	69	0,00
5,857 % fällig am 19.01.2035		215	190	0,00
HomeBanc Mortgage Trust				
5,510 % fällig am 25.12.2036		24	23	0,00
5,650 % fällig am 25.03.2035		94	76	0,00
5,670 % fällig am 25.01.2036		105	100	0,00
HSI Asset Securitization Corp. Trust				
5,590 % fällig am 25.11.2035		1.223	1.144	0,02

BESCHREIBUNG		PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
Impac Secured Assets Trust				
5,370 % fällig am 25.05.2037 ^	$	41	$ 32	0,00
IndyMac Mortgage Loan Trust				
3,103 % fällig am 25.06.2037 ^		42	34	0,00
3,244 % fällig am 25.11.2035 ^		26	19	0,00
3,334 % fällig am 25.07.2037		48	31	0,00
3,367 % fällig am 25.06.2036		109	87	0,00
3,482 % fällig am 25.08.2035		611	469	0,01
3,629 % fällig am 25.05.2037 ^		144	123	0,00
3,677 % fällig am 25.12.2036 ^		58	49	0,00
3,778 % fällig am 25.11.2035 ^		455	366	0,01
4,009 % fällig am 25.10.2034		228	217	0,00
4,032 % fällig am 25.06.2035 ^		155	131	0,00
5,510 % fällig am 25.07.2047		171	119	0,00
5,550 % fällig am 25.06.2046		546	437	0,01
5,570 % fällig am 25.07.2036		5.363	4.953	0,06
5,630 % fällig am 25.07.2035		6	5	0,00
5,750 % fällig am 25.07.2035		134	109	0,00
JPMorgan Alternative Loan Trust				
3,759 % fällig am 25.05.2036 ^		167	99	0,00
4,414 % fällig am 25.05.2037 ^		191	174	0,00
5,470 % fällig am 25.10.2036		856	763	0,01
5,843 % fällig am 26.05.2037		1.590	1.201	0,02
JPMorgan Mortgage Trust				
3,636 % fällig am 25.10.2036 ^		259	192	0,00
3,909 % fällig am 25.11.2035 ^		28	24	0,00
3,909 % fällig am 25.11.2035 ^		74	63	0,00
3,928 % fällig am 25.08.2035		23	22	0,00
4,078 % fällig am 25.10.2035 ^		129	104	0,00
4,289 % fällig am 25.06.2037 ^		164	127	0,00
4,289 % fällig am 25.06.2037 ^		39	30	0,00
4,366 % fällig am 25.07.2035		10	10	0,00
4,399 % fällig am 25.04.2035		10	10	0,00
6,000 % fällig am 25.01.2036 ^		95	48	0,00
6,500 % fällig am 25.07.2036 ^		243	98	0,00
Lehman XS Trust				
5,510 % fällig am 25.12.2036		2.102	2.039	0,03
5,550 % fällig am 25.03.2047		4.053	3.906	0,05
5,610 % fällig am 25.04.2046 ^		5	6	0,00
5,630 % fällig am 25.09.2046 ^		10	12	0,00
5,670 % fällig am 25.02.2046 ^		191	169	0,00
6,050 % fällig am 25.08.2047 ^		421	353	0,01
6,850 % fällig am 25.10.2037		1.839	1.635	0,02
Luminent Mortgage Trust				
5,550 % fällig am 25.10.2046		863	770	0,01
MASTR Adjustable Rate Mortgages Trust				
4,560 % fällig am 21.11.2034		49	46	0,00
5,750 % fällig am 25.05.2047 ^		4	4	0,00
Merrill Lynch Alternative Note Asset Trust				
5,370 % fällig am 25.03.2037		224	57	0,00
Merrill Lynch Mortgage Investors Trust				
3,612 % fällig am 25.02.2036		13	12	0,00
3,738 % fällig am 25.03.2036 ^		332	187	0,00
4,120 % fällig am 25.11.2035		88	85	0,00
4,459 % fällig am 25.05.2036		129	117	0,00
5,610 % fällig am 25.04.2029		13	12	0,00
5,810 % fällig am 25.11.2029		3	2	0,00
Merrill Lynch Mortgage-Backed Securities Trust				
3,673 % fällig am 25.04.2037 ^		21	18	0,00
Morgan Stanley Mortgage Loan Trust				
4,208 % fällig am 25.09.2035 ^		147	53	0,00
4,271 % fällig am 25.05.2036 ^		380	223	0,00
5,410 % fällig am 25.03.2036		53	37	0,00
5,470 % fällig am 25.01.2035		16	14	0,00
5,547 % fällig am 25.06.2036		28	28	0,00
6,000 % fällig am 25.10.2037 ^		1.124	678	0,01
6,115 % fällig am 25.06.2036		3	3	0,00
Morgan Stanley Re-REMIC Trust				
2,643 % fällig am 26.03.2037		73	69	0,00
2,702 % fällig am 26.02.2037		100	92	0,00
New Residential Mortgage Loan Trust				
3,500 % fällig am 25.12.2057		1.598	1.499	0,02
Nomura Asset Acceptance Corp. Alternative Loan Trust				
4,937 % fällig am 25.08.2035		26	25	0,00
Opteum Mortgage Acceptance Corp. Asset-Backed Pass-Through Certificates				
5,710 % fällig am 25.12.2035		290	269	0,01
7,175 % fällig am 25.02.2035		181	184	0,00
Prime Mortgage Trust				
6,000 % fällig am 25.06.2036 ^		7	7	0,00
RBSGC Structured Trust				
5,500 % fällig am 25.11.2035 ^	$	74	$ 62	0,00
Residential Accredit Loans, Inc. Trust				
4,073 % fällig am 25.02.2035 ^		49	40	0,00
4,310 % fällig am 25.08.2035		981	904	0,01
5,300 % fällig am 25.02.2047		719	272	0,01
5,350 % fällig am 25.05.2037		323	283	0,01
5,410 % fällig am 25.02.2037		5	18	0,00
5,430 % fällig am 25.01.2037		89	93	0,00
5,450 % fällig am 25.02.2037		226	199	0,00
5,500 % fällig am 25.08.2035 ^		406	318	0,01
5,500 % fällig am 25.03.2037 ^		71	54	0,00
5,530 % fällig am 25.08.2036 ^		111	106	0,00
5,530 % fällig am 25.09.2036 ^		428	396	0,01
5,550 % fällig am 25.11.2036 ^		144	102	0,00
5,580 % fällig am 25.05.2046		593	515	0,01
6,000 % fällig am 25.09.2035 ^		75	26	0,00
6,000 % fällig am 25.06.2036 ^		358	285	0,01
6,000 % fällig am 25.08.2036 ^		816	667	0,01
6,250 % fällig am 25.03.2037 ^		167	128	0,00
6,500 % fällig am 25.07.2037 ^		226	182	0,00
6,500 % fällig am 25.09.2037 ^		221	175	0,00
Residential Asset Securitization Trust				
5,500 % fällig am 25.09.2035 ^		83	42	0,00
5,500 % fällig am 25.12.2035 ^		203	100	0,00
6,500 % fällig am 25.04.2037 ^		1.211	350	0,01
Residential Funding Mortgage Securities, Inc. Trust				
6,000 % fällig am 25.10.2036 ^		106	81	0,00
6,000 % fällig am 25.06.2037 ^		69	51	0,00
Sequoia Mortgage Trust				
3,271 % fällig am 20.01.2047 ^		4	3	0,00
Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust				
3,525 % fällig am 25.11.2035 ^		22	19	0,00
3,665 % fällig am 25.09.2035		20	14	0,00
4,082 % fällig am 25.10.2036 ^		78	45	0,00
4,455 % fällig am 25.09.2035		69	62	0,00
4,605 % fällig am 25.11.2036 ^		335	285	0,01
4,702 % fällig am 25.04.2035		9	9	0,00
5,375 % fällig am 25.02.2035		150	143	0,00
5,470 % fällig am 25.10.2035		65	59	0,00
5,590 % fällig am 25.06.2037		106	94	0,00
7,119 % fällig am 25.10.2037 ^		69	61	0,00
Structured Asset Mortgage Investments Trust				
5,330 % fällig am 25.09.2047		36	33	0,00
5,340 % fällig am 25.09.2047		398	359	0,01
5,510 % fällig am 25.07.2046		130	108	0,00
5,530 % fällig am 25.06.2036		48	46	0,00
5,570 % fällig am 25.04.2036		34	30	0,00
5,570 % fällig am 25.05.2036		30	20	0,00
5,750 % fällig am 25.08.2036 ^		393	279	0,01
5,806 % fällig am 19.10.2034		24	22	0,00
5,846 % fällig am 19.03.2034		3	3	0,00
Structured Asset Securities Corp. Mortgage Pass-Through Certificates				
6,639 % fällig am 25.06.2033		4	4	0,00
SunTrust Alternative Loan Trust				
5,750 % fällig am 25.12.2035 ^		143	118	0,00
5,750 % fällig am 25.12.2035 ^		165	141	0,00
Thornburg Mortgage Securities Trust				
3,018 % fällig am 25.09.2037		16	15	0,00
Towd Point Mortgage Trust				
2,750 % fällig am 25.06.2057		578	545	0,01
Wachovia Mortgage Loan Trust LLC				
4,291 % fällig am 20.10.2035 ^		36	34	0,00
WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust				
3,168 % fällig am 25.01.2037 ^		12	10	0,00
3,320 % fällig am 25.05.2037 ^		13	10	0,00
3,321 % fällig am 25.04.2037 ^		9	8	0,00
3,528 % fällig am 25.12.2036 ^		8	7	0,00
3,597 % fällig am 25.07.2037 ^		463	393	0,01
3,672 % fällig am 25.08.2036 ^		44	40	0,00
3,704 % fällig am 25.02.2037 ^		29	24	0,00
3,712 % fällig am 25.10.2036 ^		266	232	0,00
3,754 % fällig am 25.09.2036 ^		24	21	0,00
3,754 % fällig am 25.09.2036 ^		85	71	0,00
3,768 % fällig am 25.12.2036 ^		23	21	0,00
3,823 % fällig am 27.02.2034		115	108	0,00
3,875 % fällig am 25.12.2035		66	61	0,00
3,883 % fällig am 25.03.2036		115	105	0,00
3,913 % fällig am 25.04.2035		11	10	0,00
4,008 % fällig am 25.12.2046		48	43	0,00
4,195 % fällig am 25.02.2033	$	8	$ 8	0,00
4,404 % fällig am 25.05.2046		64	55	0,00
4,786 % fällig am 25.07.2047		443	362	0,01
4,830 % fällig am 25.06.2033		30	29	0,00
4,976 % fällig am 25.08.2046		274	257	0,00
5,176 % fällig am 25.11.2042		3	3	0,00
5,376 % fällig am 25.04.2044		1	1	0,00
5,476 % fällig am 25.10.2046		17	16	0,00
5,730 % fällig am 25.10.2045		26	24	0,00
5,790 % fällig am 25.01.2045		291	276	0,01
5,890 % fällig am 25.11.2034		272	249	0,00
5,990 % fällig am 25.06.2044		243	224	0,00
Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates Trust				
5,470 % fällig am 25.02.2037 ^		563	428	0,01
5,500 % fällig am 25.05.2035 ^		205	162	0,00
5,500 % fällig am 25.07.2035 ^		420	368	0,01
5,500 % fällig am 25.11.2035 ^		121	104	0,00
6,000 % fällig am 25.06.2037 ^		471	425	0,01
Wells Fargo Alternative Loan Trust				
5,750 % fällig am 25.07.2037 ^		54	45	0,00
Wells Fargo Mortgage-Backed Securities Trust				
4,417 % fällig am 25.11.2037 ^		72	62	0,00
4,563 % fällig am 25.12.2036 ^		55	54	0,00
4,662 % fällig am 25.04.2036 ^		8	7	0,00
4,678 % fällig am 25.04.2036 ^		150	141	0,00
6,000 % fällig am 25.06.2037 ^		1.900	1.667	0,02
6,000 % fällig am 25.06.2037 ^		36	32	0,00
			92.520	1,16
US-REGIERUNGSBEHÖRDEN				
Uniform Mortgage-Backed Security				
5,500 % fällig am 01.12.2052		15.643	15.590	0,20
Uniform Mortgage-Backed Security, TBA				
5,000 % fällig am 01.07.2053		154.300	151.216	1,90
5,500 % fällig am 01.08.2053		147.900	147.172	1,85
6,000 % fällig am 01.08.2053		64.200	64.757	0,82
6,500 % fällig am 01.08.2053		95.300	97.251	1,22
			475.986	5,99
US-SCHATZOBLIGATIONEN				
U.S. Treasury Bonds				
4,000 % fällig am 15.11.2042		98.500	97.915	1,23
Summe USA			2.238.376	28,18
VENEZUELA				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Petroleos de Venezuela S.A.				
6,000 % fällig am 16.05.2024 ^		8.400	326	0,00
STAATSEMISSIONEN				
Venezuela Government International Bond				
6,000 % fällig am 09.12.2020 ^		2.651	166	0,00
7,000 % fällig am 31.03.2038 ^		16.792	1.469	0,02
9,250 % fällig am 07.05.2028 ^		7.813	703	0,01
			2.338	0,03
Summe Venezuela			2.664	0,03
KURZFRISTIGE INSTRUMENTE				
KURZFRISTIGE SCHULDTITEL				
Corestate Capital Holding S.A.				
15,000 % fällig am 31.07.2023 (g)	€	1.700	1.873	0,02
Federal Home Loan Bank				
5,170 % fällig am 29.11.2023	$	158.500	158.567	2,00
Summe kurzfristige Instrumente			160.440	2,02
Summe Übertragbare Wertpapiere			**$ 6.106.201**	**76,88**
		AKTIEN		
INVESTMENTFONDS				
ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN				
PIMCO Funds: Global Investors Series plc - Asia Strategic Interest Bond Fund (e)		3.488.745	31.189	0,39

BESCHREIBUNG	AKTIEN	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
PIMCO Funds: Global Investors Series plc - PIMCO Asia High Yield Bond Fund (e)	7.821.400	$ 71.097	0,90
PIMCO Funds: Global Investors Series plc - US Short-Term Fund (e)	33.191.429	333.242	4,20

BESCHREIBUNG	AKTIEN	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (e)	9.278.795	$ 92.398	1,16
		527.926	6,65

BESCHREIBUNG	AKTIEN	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
BÖRSENGEHANDELTE FONDS			
PIMCO ETFs plc - PIMCO US Dollar Short Maturity UCITS ETF (e)	2.698.640	$ 268.056	3,37
Summe Anlagefonds*		**$ 795.982**	**10,02**

* Das Engagement des Diversified Income Fund in den Anlagefonds stieg etwas über 10 %. Ab dem 3. Juli 2023 erfüllte der Fonds die Vorgaben wieder.

PENSIONSGESCHÄFTE

Kontrahent	Kredit-zins	Abrechnungs-datum	Fälligkeits-datum	Kapital-betrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensions-geschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensions-geschäft[1]	% des Nettovermögens
BPS	5,080 %	30.06.2023	07.07.2023	$ 250.000	U.S. Treasury Notes 0,250 % - 1,875 % fällig am 31.07.2025 - 31.08.2027	$ (255.041)	$ 250.000	$ 250.247	3,15
	5,160	30.06.2023	03.07.2023	1.600	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.07.2031	(1.640)	1.600	1.601	0,02
BRC	5,120	30.06.2023	03.07.2023	401.800	U.S. Treasury Notes 3,875 % fällig am 30.04.2025	(410.212)	401.800	401.971	5,07
	5,130	30.06.2023	03.07.2023	97.700	Ginnie Mae 2,500 % fällig am 20.08.2051	(100.088)	97.700	97.742	1,23
	5,180	30.06.2023	03.07.2023	343.200	U.S. Treasury Bonds 2,250 % - 4,250 % fällig am 15.05.2039 - 15.08.2046	(353.153)	343.200	343.348	4,32
FICC	2,400	30.06.2023	03.07.2023	37.737	U.S. Treasury Notes 4,625 % fällig am 30.06.2025	(38.492)	37.737	37.737	0,48
	5,060	30.06.2023	03.07.2023	67.700	U.S. Treasury Notes 3,875 % fällig am 31.12.2027	(69.054)	67.700	67.729	0,85
MBC	5,160	30.06.2023	03.07.2023	36.100	U.S. Treasury Notes 4,125 % fällig am 15.11.2032	(37.293)	36.100	36.116	0,45
TDM	5,160	30.06.2023	03.07.2023	800	U.S. Treasury Notes 1,250 % fällig am 31.03.2028	(821)	800	800	0,01
Summe Pensionsgeschäfte						**$ (1.265.794)**	**$ 1.236.637**	**$ 1.237.291**	**15,58**

(1) Umfasst aufgelaufene Zinsen.

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

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

FUTURES

Beschreibung	Art	Ablauf-monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Australia Government 10-Year Bond September Futures	Long	09.2023	156	$ (67)	0,00
Euro-Bund 10-Year Bond September Futures	Long	09.2023	1.739	(2.734)	(0,03)
Euro-Schatz September Futures	Short	09.2023	8.584	7.405	0,09
U.S. Treasury 2-Year Note September Futures	Long	09.2023	3.590	(10.143)	(0,13)
U.S. Treasury 5-Year Note September Futures	Long	09.2023	8.296	(16.784)	(0,22)
U.S. Treasury 10-Year Note September Futures	Long	09.2023	7.062	(13.331)	(0,17)
U.S. Treasury 10-Year Ultra September Futures	Long	09.2023	802	(983)	(0,01)
U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond September Futures	Long	09.2023	2.569	4.369	0,06
				$ (32.268)	(0,41)
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate				**$ (32.268)**	**(0,41)**

ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)

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

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMMISSIONEN - SCHUTZVERKAUF[1]

Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag[2]	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
AT&T, Inc.	1,000 %	20.06.2024	$ 18.200	$ 75	0,00
AT&T, Inc.	1,000	20.06.2026	12.800	(138)	0,00
AT&T, Inc.	1,000	20.06.2028	4.400	32	0,00
Boeing Co.	1,000	20.12.2023	1.300	(7)	0,00
Boeing Co.	1,000	20.12.2026	500	6	0,00
Boeing Co.	1,000	20.06.2027	1.200	6	0,00
CCO Holdings LLC	5,000	20.12.2027	21.000	63	0,00
Ford Motor Co.	5,000	20.12.2023	3.700	(641)	(0,01)
Ford Motor Credit Co. LLC	5,000	20.12.2024	600	8	0,00
Ford Motor Credit Co. LLC	5,000	20.06.2025	1.300	38	0,00
Ford Motor Credit Co. LLC	5,000	20.06.2026	800	35	0,00

Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag[2]	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Ford Motor Credit Co. LLC	5,000 %	20.06.2027	$ 6.900	$ 136	0,00
General Electric Co.	1,000	20.06.2024	14.300	389	0,01
General Electric Co.	1,000	20.06.2026	35.000	149	0,00
General Electric Co.	1,000	20.12.2026	4.300	0	0,00
General Motors Co.	5,000	20.06.2026	4.200	(339)	0,00
Glencore Finance Europe Ltd.	5,000	20.12.2025	€ 35.900	(4.245)	(0,05)
Glencore Finance Europe Ltd.	5,000	20.12.2027	26.000	(3.310)	(0,04)
Marks & Spencer PLC	1,000	20.12.2024	18.600	1.003	0,01
Marks & Spencer PLC	1,000	20.12.2028	11.000	185	0,00
Rolls-Royce PLC	1,000	20.12.2024	40.600	(143)	0,00
T-Mobile USA, Inc.	5,000	20.06.2028	$ 1.400	6	0,00
Volkswagen International Finance NV	1,000	20.12.2026	€ 19.300	(272)	0,00
Volkswagen International Finance NV	1,000	20.06.2027	8.300	282	0,00
				$ (6.682)	(0,08)

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES - SCHUTZVERKAUF[1]

Index/Tranchen	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag[2]	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
CDX.EM-39 5-Year Index	1,000 %	20.06.2028	$ 55.500	$ 1.361	0,02
CDX.HY-39 5-Year Index	5,000	20.12.2027	69.102	349	0,00
CDX.HY-40 5-Year Index	5,000	20.06.2028	527.500	14.785	0,19
CDX.IG-40 5-Year Index	1,000	20.06.2028	270.800	1.929	0,02
				$ 18.424	0,23

ZINSSWAPS

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Erhalt	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	0,500 %	16.09.2025	£ 21.100	$ 3.581	0,04
Zahlung[3]	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	3,250	20.09.2053	5.100	(459)	(0,01)
Erhalt[3]	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	3,750	20.09.2028	46.400	2.960	0,04
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,400	15.06.2032	¥ 12.250.000	(196)	0,00
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	0,880	03.03.2024	CAD 273.400	(9.072)	(0,11)
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	2,500	19.06.2029	91.700	(8.700)	(0,11)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	1,520	07.07.2027	€ 127.500	(6.726)	(0,09)
Erhalt[3]	6-Month EUR-EURIBOR	2,500	20.09.2053	4.400	(54)	0,00
					$ (18.666)	(0,24)
Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate					**$ (6.924)**	**(0,09)**

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

(2) Der maximal mögliche Betrag, den der Fonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

(3) Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft.

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

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

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMMISSIONEN - SCHUTZVERKAUF[1]

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag[2]	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Markt-wert	% des Nettovermögens
BOA	South Africa Government International Bond	1,000 %	20.06.2028	$ 22.000	$ (1.915)	$ 375	$ (1.540)	(0,02)
BRC	Indonesia Government International Bond	1,000	20.06.2031	61.600	(2.646)	1.374	(1.272)	(0,02)
	Intrum AB	5,000	20.12.2024	€ 1.200	113	(195)	(82)	0,00
DUB	Eskom Holdings SOC Ltd.	4,650	30.06.2029	$ 5.000	0	155	155	0,00
FBF	Intrum AB	5,000	20.12.2024	€ 4.400	415	(715)	(300)	0,00
GST	ADLER Real Estate AG	5,000	20.12.2026	7.400	(46)	(1.782)	(1.828)	(0,02)
	Intrum AB	5,000	20.12.2024	41.200	4.386	(7.197)	(2.811)	(0,03)
JPM	Hochtief AG	5,000	20.12.2026	16.400	3.874	(1.560)	2.314	0,03
	Intrum AB	5,000	20.12.2024	1.000	92	(160)	(68)	0,00
MYC	Intrum AB	5,000	20.12.2024	6.400	650	(1.087)	(437)	(0,01)
MYI	Intrum AB	5,000	20.12.2024	8.200	893	(1.452)	(559)	(0,01)
					$ 5.816	$ (12.244)	$ (6.428)	(0,08)

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

(2) Der maximal mögliche Betrag, den der Fonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung		Zu erhaltende Währung		Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	08.2023	AUD	1.954	$	1.322	$ 20	$ 0	$ 20	0,00
	08.2023	$	131	CNY	900	0	(7)	(7)	0,00
	08.2023		7.940	€	7.334	82	(5)	77	0,00
	08.2023		1.443	£	1.140	7	0	7	0,00
BPS	07.2023	€	1.991.475	$	2.140.851	0	(31.849)	(31.849)	(0,40)
	08.2023		5.358		5.745	0	(113)	(113)	0,00
	08.2023	$	155	CNY	1.058	0	(8)	(8)	0,00
	08.2023		61.924	€	56.604	42	(83)	(41)	0,00
	08.2023		3.032	£	2.381	0	(4)	(4)	0,00
	12.2023	MXN	10.668	$	598	0	(5)	(5)	0,00
BRC	08.2023	¥	31.340		237	19	0	19	0,00
	08.2023	$	32.808	€	30.341	362	0	362	0,00
	08.2023		24.085	£	19.305	464	0	464	0,01
CBK	07.2023		2.165.160	€	1.991.475	7.541	0	7.541	0,10
	08.2023	AUD	199	$	131	0	(2)	(2)	0,00
	08.2023	CAD	458		343	0	(3)	(3)	0,00
	08.2023	CNH	43		6	0	0	0	0,00
	08.2023	€	2.024.945		2.204.411	0	(7.855)	(7.855)	(0,10)
	08.2023	£	288.389		359.632	0	(7.100)	(7.100)	(0,09)
	08.2023	NOK	741		71	2	0	2	0,00
	08.2023	SEK	2.188		216	13	0	13	0,00
	08.2023	$	12.313	€	11.366	119	(6)	113	0,00
	08.2023		1.037	£	837	27	0	27	0,00
GLM	08.2023	NOK	941	$	89	1	0	1	0,00
JPM	07.2023	$	599	MXN	10.335	3	0	3	0,00
	08.2023	CAD	752	$	563	0	(6)	(6)	0,00
	08.2023	$	163	CNY	1.116	0	(9)	(9)	0,00
	08.2023		15.106	€	13.975	174	(2)	172	0,00
	08.2023		20.786	£	16.411	84	0	84	0,00
	09.2023	INR	28.628	$	347	0	(1)	(1)	0,00
	10.2023	MXN	66.385		3.781	0	(15)	(15)	0,00
MBC	08.2023	CAD	2.323		1.746	0	(11)	(11)	0,00
	08.2023	$	320.729	€	290.653	0	(2.971)	(2.971)	(0,04)
MYI	07.2023	£	173	$	219	0	(1)	(1)	0,00
	07.2023	MXN	1.300		76	0	0	0	0,00
	07.2023	$	50	AUD	76	0	0	0	0,00
	07.2023		2.148	€	1.972	3	0	3	0,00
	07.2023		5.954	£	4.718	45	0	45	0,00
	08.2023	AUD	172	$	115	0	0	0	0,00
	08.2023	€	2.630		2.878	2	0	2	0,00
	08.2023	¥	448.787		3.377	252	0	252	0,00
	08.2023	$	6.193	€	5.704	43	0	43	0,00
	09.2023	INR	6.183	$	75	0	0	0	0,00
RBC	07.2023	$	3.836	MXN	73.804	460	0	460	0,01
	08.2023	MXN	186	$	11	0	0	0	0,00
	08.2023	$	4.080	£	3.229	26	0	26	0,00
RYL	08.2023	€	26.474	$	28.686	0	(257)	(257)	0,00
	08.2023	$	3.295	€	3.051	40	0	40	0,00
SCX	08.2023	€	26.951	$	29.590	126	0	126	0,00
	08.2023	$	434	CNY	2.963	0	(24)	(24)	0,00
	09.2023	INR	17.904	$	217	0	0	0	0,00
SOG	07.2023	$	766	PLN	3.302	46	0	46	0,00
TOR	08.2023	¥	206.694	$	1.559	120	0	120	0,00
UAG	08.2023	CAD	2.411		1.784	0	(40)	(40)	0,00
	08.2023	$	7.132	€	6.577	58	0	58	0,00
	08.2023		18.170	£	14.375	110	0	110	0,00
	09.2023	SGD	39	$	29	0	0	0	0,00
	09.2023	$	1.156	ZAR	20.273	0	(91)	(91)	0,00
						$ 10.291	$ (50.468)	$ (40.177)	(0,51)

ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklasse M Retail AUD (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung		Zu erhaltende Währung		Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
AZD	07.2023	AUD	2.656	$	1.763	$ 0	$ (5)	$ (5)	0,00
	07.2023	$	3.278	AUD	5.009	56	0	56	0,00
	08.2023		1.764		2.656	5	0	5	0,00
BOA	07.2023	AUD	10	$	7	0	0	0	0,00
	07.2023	$	6.607	AUD	10.160	156	0	156	0,01
BPS	07.2023	AUD	13.951	$	9.237	0	(49)	(49)	0,00
	07.2023	$	5	AUD	7	0	0	0	0,00
	08.2023		9.014		13.598	45	0	45	0,00

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
CBK	07.2023	AUD 82	$ 56	$ 1	$ 0	$ 1	0,00
	07.2023	$ 2.120	AUD 3.250	43	0	43	0,00
JPM	07.2023	3.226	4.935	59	0	59	0,00
MBC	07.2023	AUD 21	$ 14	0	0	0	0,00
SCX	07.2023	4.686	3.111	0	(8)	(8)	0,00
	07.2023	$ 2.580	AUD 3.948	48	0	48	0,00
	08.2023	3.113	4.686	8	0	8	0,00
SOG	07.2023	5.127	7.837	89	0	89	0,00
TOR	07.2023	AUD 8.181	$ 5.404	0	(42)	(42)	0,00
	07.2023	$ 5.447	AUD 8.329	97	0	97	0,00
	08.2023	5.408	8.181	42	0	42	0,00
UAG	07.2023	AUD 15.788	$ 10.483	20	(46)	(26)	0,00
	07.2023	$ 2.624	AUD 4.009	44	0	44	0,00
	08.2023	10.481	15.772	46	(20)	26	0,00
				$ 759	$ (170)	$ 589	0,01

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklasse Institutional CAD (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2023	$ 105.228	CAD 143.182	$ 2.977	$ 0	$ 2.977	0,04
BPS	07.2023	CAD 2.101	$ 1.589	1	0	1	0,00
CBK	07.2023	700	527	0	(2)	(2)	0,00
	07.2023	$ 3.605	CAD 4.913	107	0	107	0,00
JPM	07.2023	105.613	143.280	2.665	0	2.665	0,03
MBC	07.2023	CAD 2.517	$ 1.870	0	(32)	(32)	0,00
RBC	07.2023	$ 3	CAD 4	0	0	0	0,00
SCX	07.2023	106.146	144.161	2.799	0	2.799	0,04
TOR	07.2023	CAD 256.526	$ 193.615	80	(326)	(246)	0,00
	08.2023	$ 193.615	CAD 256.424	327	(79)	248	0,00
				$ 8.956	$ (439)	$ 8.517	0,11

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklassen Institutional CHF (Hedged) thesaurierend, Institutional CHF (Hedged) ausschüttend, Class E CHF (Hedged) thesaurierend, Class W CHF (Hedged) thesaurierend und Class W CHF (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BPS	07.2023	CHF 9.120	$ 10.197	$ 3	$ 0	$ 3	0,00
	07.2023	$ 13.850	CHF 12.530	155	0	155	0,00
	08.2023	10.197	9.094	0	(3)	(3)	0,00
JPM	07.2023	CHF 39	$ 43	0	0	0	0,00
MBC	07.2023	114	127	0	0	0	0,00
	07.2023	$ 7	CHF 6	0	0	0	0,00
MYI	07.2023	CHF 277	$ 307	0	(4)	(4)	0,00
RBC	07.2023	577	646	1	0	1	0,00
RYL	07.2023	4	5	0	0	0	0,00
SCX	07.2023	$ 10.007	CHF 8.992	43	0	43	0,00
UAG	07.2023	CHF 9.523	$ 10.623	0	(21)	(21)	0,00
	07.2023	$ 9.049	CHF 8.131	39	0	39	0,00
	08.2023	10.508	9.392	21	0	21	0,00
				$ 262	$ (28)	$ 234	0,00

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklassen Institutional EUR (Hedged) thesaurierend, Institutional EUR (Hedged) ausschüttend, Investor EUR (Hedged) thesaurierend, Investor EUR (Hedged) ausschüttend, Administrative EUR (Hedged) thesaurierend, Class E EUR (Hedged) thesaurierend, Class E EUR (Hedged) ausschüttend, Class T EUR (Hedged) thesaurierend, Class T EUR (Hedged) ausschüttend, Class W EUR (Hedged) thesaurierend und Class W EUR (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2023	€ 4.702	$ 5.124	$ 6	$ (12)	$ (6)	0,00
	07.2023	$ 1.094.208	€ 1.018.148	16.593	0	16.593	0,21
BPS	07.2023	€ 1.020.099	$ 1.117.700	4.777	(5)	4.772	0,06
	07.2023	$ 1.092.384	€ 1.016.164	16.252	0	16.252	0,20
	08.2023	1.110.013	1.011.642	0	(4.801)	(4.801)	(0,06)
CBK	07.2023	€ 1.034.212	$ 1.124.010	9	(4.326)	(4.317)	(0,05)
	08.2023	$ 1.082.832	€ 994.579	3.740	0	3.740	0,05
JPM	07.2023	€ 1.011.775	$ 1.104.758	910	0	910	0,01
	07.2023	$ 45.124	€ 42.205	921	0	921	0,01
	08.2023	1.106.303	1.011.775	0	(945)	(945)	(0,01)
MBC	07.2023	€ 22.691	$ 24.437	16	(335)	(319)	0,00
SOG	07.2023	$ 1.093.128	€ 1.016.164	15.509	0	15.509	0,19
				$ 58.733	$ (10.424)	$ 48.309	0,61

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklassen Institutional GBP (Hedged) thesaurierend, Institutional GBP (Hedged) ausschüttend, Administrative GBP (Hedged) ausschüttend, Class W GBP (Hedged) thesaurierend und Class W GBP (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung		Zu erhaltende Währung		Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2023	£	304	$	384	$ 0	$ (3)	$ (3)	0,00
	07.2023	$	86	£	67	0	0	0	0,00
BPS	07.2023	£	1.386	$	1.723	2	(42)	(40)	0,00
	07.2023	$	359.899	£	290.972	10.028	0	10.028	0,13
BRC	07.2023	£	345	$	434	1	(5)	(4)	0,00
	07.2023	$	1.045	£	839	22	0	22	0,00
CBK	07.2023	£	1.141	$	1.444	1	(8)	(7)	0,00
	07.2023	$	112	£	88	1	0	1	0,00
JPM	07.2023	£	292.056	$	369.275	0	(2.031)	(2.031)	(0,03)
	08.2023	$	369.354	£	292.056	2.026	0	2.026	0,03
MBC	07.2023	£	114	$	146	1	0	1	0,00
	07.2023	$	362.027	£	292.451	9.780	0	9.780	0,12
MYI	07.2023	£	118	$	147	0	(4)	(4)	0,00
	07.2023	$	358.803	£	288.691	8.224	0	8.224	0,10
TOR	07.2023	£	292.594	$	371.799	0	(190)	(190)	0,00
	08.2023	$	371.880	£	292.594	184	0	184	0,00
						$ 30.270	$ (2.283)	$ 27.987	0,35

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklasse Administrative JPY (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung		Zu erhaltende Währung		Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2023	¥	3.024	$	22	$ 1	$ 0	$ 1	0,00
	07.2023	$	884	¥	122.915	0	(34)	(34)	0,00
BPS	07.2023		884		122.915	0	(34)	(34)	0,00
SCX	07.2023		797		110.715	0	(31)	(31)	0,00
						$ 1	$ (99)	$ (98)	0,00

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklasse Institutional MXN (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung		Zu erhaltende Währung		Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BPS	07.2023	MXN	147.822	$	8.587	$ 0	$ (33)	$ (33)	0,00
	07.2023	$	6.653	MXN	119.686	325	0	325	0,01
	08.2023		8.539		147.822	34	0	34	0,00
BRC	07.2023	MXN	147.434	$	8.581	0	(15)	(15)	0,00
	08.2023	$	8.533	MXN	147.434	17	0	17	0,00
CBK	07.2023	MXN	147.434	$	8.578	0	(18)	(18)	0,00
	07.2023	$	6.235	MXN	112.151	304	0	304	0,00
	08.2023		8.994		155.434	20	0	20	0,00
GLM	07.2023		3.127		56.273	154	0	154	0,00
MYI	07.2023		1.286		22.238	11	0	11	0,00
	08.2023		227		3.892	0	(1)	(1)	0,00
RBC	07.2023		1.247		21.601	12	0	12	0,00
SCX	07.2023		6.165		110.741	292	0	292	0,00
						$ 1.169	$ (67)	$ 1.102	0,01

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklassen Institutional SEK (Hedged) thesaurierend und Administrative SEK (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung		Zu erhaltende Währung		Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2023	SEK	57.153	$	5.296	$ 4	$ 0	$ 4	0,00
	08.2023	$	5.212	SEK	56.179	0	(5)	(5)	0,00
CBK	07.2023		3.570		38.996	40	0	40	0,00
MBC	07.2023		3.494		37.631	0	(10)	(10)	0,00
MYI	07.2023	SEK	56.273	$	5.212	2	0	2	0,00
	07.2023	$	5.026	SEK	53.949	0	(31)	(31)	0,00
	08.2023		5.212		56.203	0	(2)	(2)	0,00
SCX	07.2023		3.501		37.867	5	0	5	0,00
						$ 51	$ (48)	$ 3	0,00

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklassen Institutional SGD (Hedged) ausschüttend, Administrative SGD (Hedged) ausschüttend, Class E SGD (Hedged) ausschüttend und Class W SGD (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung		Zu erhaltende Währung		Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BRC	07.2023	$	29.664	SGD	40.139	$ 0	$ (5)	$ (5)	0,00
GLM	07.2023	SGD	942	$	701	6	0	6	0,00
	07.2023	$	542	SGD	729	0	(3)	(3)	0,00

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
JPM	07.2023	SGD 40.283	$ 29.769	$ 3	$ 0	$ 3	0,00
	07.2023	$ 3.907	SGD 5.287	0	0	0	0,00
	08.2023	29.769	40.245	0	(2)	(2)	0,00
MBC	07.2023	27.101	36.616	0	(45)	(45)	0,00
	08.2023	60	81	0	0	0	0,00
MYI	07.2023	SGD 39.938	$ 29.556	46	(1)	45	0,00
	08.2023	$ 28.847	SGD 38.943	0	(43)	(43)	0,00
UAG	07.2023	29.482	39.880	0	(15)	(15)	0,00
				$ 55	$ (114)	$ (59)	0,00

Summe Freiverkehrsfinanzderivate	**$ 39.979**	**0,50**
Summe Anlagen	**$ 8.139.607**	**102,48**
Sonstige Aktiva und Passiva	**$ (196.890)**	**(2,48)**
Nettovermögen	**$ 7.942.717**	**100,00**

ERLÄUTERUNGEN ZUR AUFSTELLUNG DES WERTPAPIERBESTANDS (Angaben in Tausend*):

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

^ **Das Wertpapier ist in Verzug.**

(a) **Wertpapier mit Sachwertausschüttung.**

(b) **Das Wertpapier hat in den letzten zwölf Monaten keine Erträge geliefert.**

(c) **Nullkuponwertpapier.**

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

(e) **Mit dem Fonds verbunden.**

(f) **Bedingt wandelbares Wertpapier.**

(g) **Eingeschränkte Wertpapiere (31. Dezember 2022: 0,18 %):**

Emittentenbeschreibung	Kauf-datum	Kosten	Markt-wert	% des Nettovermögens
Citigroup, Inc. 2,572 % fällig am 03.06.2031	26.05.2020	$ 6.900	$ 5.760	0,07
Constellation Oil Services Holding S.A. 'B'	10.06.2022	92	92	0,00
Corestate Capital Holding S.A. 15,000 %, fällig am 31.07.2023	06.12.2022	1.785	1.873	0,02
Deutsche Bank AG 3,035 %, fällig am 28.05.2032	25.05.2021 - 29.07.2021	1.122	867	0,01
Deutsche Bank AG 3,729 %, fällig am 14.01.2032	12.08.2022 - 16.08.2022	2.323	2.195	0,03
DrillCo Holding Lux S.A.	08.06.2023	8.869	8.513	0,11
General Motors Co. 6,800 % fällig am 01.10.2027	07.05.2020	699	728	0,01
Intelsat Emergence S.A.	24.02.2020 - 29.10.2021	16.083	4.235	0,05
		$ 37.873	$ 24.263	0,30

(h) **Wertpapiere mit einem gesamten beizulegenden Zeitwert von 62.998 USD (31. Dezember 2022: 6.805 USD) und Barmittel in Höhe von null USD (31. Dezember 2022: 4.245 USD) wurden zum 30. Juni 2023 gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte als Sicherheit verpfändet.**

Barmittel in Höhe von 288 USD (31. Dezember 2022: 277 USD) wurden zum 30. Juni 2023 gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte als Sicherheit geliefert.

Barmittel in Höhe von 192.048 USD (31. Dezember 2022: 268.487 USD) wurden zum 30. Juni 2023 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Barmittel in Höhe von 17.052 USD (31. Dezember 2022: 9.202 USD) wurden zum 30. Juni 2023 gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. als Sicherheit für Finanzderivate verpfändet.

Beizulegender Zeitwert[1]

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 30. Juni 2023 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie[2]	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	$ 0	$ 6.070.952	$ 35.249	$ 6.106.201
Investmentfonds	795.982	0	0	795.982
Pensionsgeschäfte	0	1.236.637	0	1.236.637
Finanzderivate[3]	4.603	(3.971)	155	787
Summen	**$ 800.585**	**$ 7.303.618**	**$ 35.404**	**$ 8.139.607**

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

Kategorie[2]	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	$ 0	$ 6.595.189	$ 25.428	$ 6.620.617
Investmentfonds	609.289	267.341	0	876.630
Pensionsgeschäfte	0	1.746.323	0	1.746.323
Finanzderivate[3]	69	(18.207)	0	(18.138)
Summen	**$ 609.358**	**$ 8.590.646**	**$ 25.428**	**$ 9.225.432**

(1) Siehe Erläuterung 3 in den Erläuterungen zum Abschluss für weitere Informationen.

(2) Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung des Wertpapierbestands.

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

Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2023:

Kontrahent	Kredit-zins	Abrechnungs-datum	Fälligkeits-datum	Kredit-betrag	Verbindlichkeiten aus umgekehrten Pensions-geschäften	% des Nettovermögens
BRC	2,750 %	10.05.2023	TBD[1]	€ (17.524)	$ (19.189)	(0,24)
	3,050	10.05.2023	TBD[1]	(666)	(729)	(0,01)
JML	2,500	10.05.2023	TBD[1]	(17.980)	(19.681)	(0,25)
	2,500	06.06.2023	TBD[1]	(2.528)	(2.762)	(0,03)
	2,500	08.06.2023	TBD[1]	(2.124)	(2.321)	(0,03)
	2,500	12.06.2023	TBD[1]	(1.273)	(1.390)	(0,02)
MYI	1,500	10.05.2023	TBD[1]	(3.011)	(3.293)	(0,04)
	1,750	10.05.2023	TBD[1]	(4.384)	(4.794)	(0,06)
	2,500	10.05.2023	TBD[1]	(3.343)	(3.655)	(0,05)
	2,500	26.05.2023	TBD[1]	(4.921)	(5.381)	(0,07)
Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte					**$ (63.195)**	**(0,80)**

(1) Umgekehrtes Pensionsgeschäft mit offener Laufzeit.

Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC-Finanzderivate und -Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2023 und 31. Dezember 2022:

	Zum 30. Jun. 2023			Zum 31. Dez. 2022		
Kontrahent	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-engagement[1]	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Nettoengagement[1]
AZD	$ 56	$ (40)	$ 16	$ 58	$ 0	$ 58
BOA	18.240	(14.110)	4.130	941	(920)	21
BPS	(5.365)	6.570	1.205	650	(800)	(150)
BRC	(494)	670	176	(2.633)	2.650	17
CBK	(7.352)	4.410	(2.942)	(1.931)	1.730	(201)
DUB	155	(180)	(25)	k. A.	k. A.	k. A.
FBF	(300)	260	(40)	(104)	260	156
GLM	158	0	158	233	(250)	(17)
GST	(4.639)	4.592	(47)	(2.878)	2.952	74
JPM	6.080	(5.590)	490	2.534	(3.820)	(1.286)
MBC	6.393	(3.110)	3.283	27.060	(25.160)	1.900
MYC	(437)	270	(167)	(152)	260	108
MYI	7.982	(5.140)	2.842	(196)	260	64
RBC	499	(300)	199	(385)	430	45
RYL	(217)	280	63	k. A.	k. A.	k. A.
SCX	3.258	(3.110)	148	561	(330)	231
SOG	15.644	(11.550)	4.094	k. A.	k. A.	k. A.
TOR	213	(140)	73	(772)	660	(112)
UAG	105	0	105	302	0	302

(1) Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären.

Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung des Wertpapierbestands zum 30. Juni 2023:

	30. Jun. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	53,21	48,23
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	23,55	25,74
Sonstige übertragbare Wertpapiere	0,12	1,67
Investmentfonds	10,02	10,02
Pensionsgeschäfte	15,58	19,95
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	(0,41)	(0,32)
Zentral abgerechnete Finanzderivate	(0,09)	(0,15)
Freiverkehrsfinanzderivate	0,50	0,27
Umgekehrte Pensionsgeschäfte	(0,80)	(0,08)

Das Anlageportfolio des Fonds konzentriert sich zum 30. Juni 2023 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	30. Jun. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
Albanien	0,21	0,18
Argentinien	0,64	0,52
Australien	0,08	0,07
Weissrussland	k. A.	0,03
Bermuda	0,82	0,72
Brasilien	0,00	0,00
Kanada	0,45	0,29
Cayman-Inseln	1,86	2,14
Chile	0,08	0,08
China	0,01	0,03
Kolumbien	0,47	0,42
Zypern	0,20	0,17
Dänemark	0,16	0,14
Dominikanische Republik	0,44	0,38
Ecuador	0,21	0,25
Ägypten	0,50	0,56
Finnland	0,05	0,08
Frankreich	2,25	3,16
Deutschland	2,22	3,24
Ghana	0,08	0,06
Guernsey, Kanalinseln	0,27	0,54
Hongkong	0,27	0,98
Indien	k. A.	0,02
Indonesien	0,91	0,60
International	0,11	k. A.
Irland	6,48	6,34
Israel	k. A.	0,11
Italien	3,87	3,95
Elfenbeinküste	0,17	0,12
Japan	0,52	0,92
Jersey, Kanalinseln	1,03	1,02
Jordanien	0,05	k. A.
Kasachstan	0,07	k. A.
Liberia	0,02	k. A.
Luxemburg	3,21	3,92
Mazedonien	0,09	0,08
Mauritius	k. A.	0,08
Mexiko	2,03	1,79
Multinational	0,37	0,33
Niederlande	3,43	3,82
Nigeria	0,50	0,41
Oman	0,36	0,31
Panama	0,28	0,25
Peru	0,24	k. A.
Philippinen	0,03	k. A.
Portugal	0,16	0,14
Katar	0,13	0,12
Rumänien	0,33	0,07
Russland	0,20	0,29
Saudi-Arabien	0,79	k. A.
Serbien	0,20	0,07
Singapur	0,17	0,15
Slowenien	0,19	0,16
Südafrika	0,20	0,09
Spanien	0,97	0,97
Sri Lanka	0,13	0,08
Schweden	0,40	0,37
Schweiz	0,99	1,22
Türkei	0,77	0,70
Ukraine	0,29	0,22
Vereinigte Arabische Emirate	0,14	0,13
Großbritannien	5,55	7,14
USA	28,18	22,65
Venezuela	0,03	0,03
Jungferninseln (Britisch)	k. A.	0,06
Kurzfristige Instrumente	2,02	2,87
Investmentfonds	10,02	10,02
Pensionsgeschäfte	15,58	19,95
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	(0,41)	(0,32)
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	(0,08)	(0,12)
Credit Default Swaps auf Kreditindizes– Schutzverkauf	0,23	0,18
Zinsswaps	(0,24)	(0,21)
Freiverkehrsfinanzderivate		
Verkaufsoptionen		
Credit Default Swaptions auf Kreditindizes	k. A.	0,00
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	(0,08)	(0,02)
Devisenterminkontrakte	(0,51)	(0,76)
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	1,09	1,05
Sonstige Aktiva und Passiva	(2,48)	(5,41)
Nettovermögen	100,00	100,00

BESCHREIBUNG		PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE				
ARGENTINIEN				
STAATSEMISSIONEN				
Argentina Government International Bond				
1,500 % fällig am 09.07.2035	$	1.252	$ 378	0,07
3,500 % fällig am 09.07.2041		9.422	3.034	0,58
Provincia de Buenos Aires				
88,734 % fällig am 12.04.2025 (a)	ARS	610	1	0,00
Summe Argentinien			3.413	0,65
BERMUDA				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Aircastle Ltd.				
2,850 % fällig am 26.01.2028	$	1.100	937	0,18
5,250 % fällig am 11.08.2025		2.250	2.175	0,42
NCL Corp. Ltd.				
8,375 % fällig am 01.02.2028		500	523	0,10
Summe Bermuda			3.635	0,70
BRASILIEN				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Odebrecht Oil & Gas Finance Ltd.				
0,000 % fällig am 31.07.2023 (e)(g)		2.332	6	0,00
KANADA				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Air Canada Pass-Through Trust				
5,250 % fällig am 01.10.2030		480	466	0,09
Fairfax Financial Holdings Ltd.				
2,750 % fällig am 29.03.2028	€	2.000	1.967	0,38
Open Text Corp.				
3,875 % fällig am 15.02.2028	$	700	617	0,12
Summe Kanada			3.050	0,59
CAYMAN INSELN				
FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE				
Vibrant CLO Ltd.				
6,290 % fällig am 15.09.2030		251	248	0,05
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Avolon Holdings Funding Ltd.				
2,125 % fällig am 21.02.2026		500	445	0,08
2,528 % fällig am 18.11.2027		1.627	1.373	0,26
3,250 % fällig am 15.02.2027		300	268	0,05
Gaci First Investment Co.				
4,750 % fällig am 14.02.2030		2.000	1.971	0,38
5,125 % fällig am 14.02.2053		800	721	0,14
Kaisa Group Holdings Ltd.				
9,375 % fällig am 30.06.2024 ^		1.100	73	0,01
9,750 % fällig am 28.09.2023 ^		3.000	201	0,04
10,500 % fällig am 15.01.2025 ^		2.200	147	0,03
10,875 % fällig am 23.07.2023 ^		400	25	0,00
11,250 % fällig am 16.04.2025 ^		1.500	100	0,02
11,650 % fällig am 01.06.2026 ^		1.000	67	0,01
11,700 % fällig am 11.11.2025 ^		400	27	0,01
Lima Metro Line Finance Ltd.				
5,875 % fällig am 05.07.2034		413	402	0,08
Melco Resorts Finance Ltd.				
4,875 % fällig am 06.06.2025		700	668	0,13
5,375 % fällig am 04.12.2029		500	415	0,08
Park Aerospace Holdings Ltd.				
5,500 % fällig am 15.02.2024		40	40	0,01
Sands China Ltd.				
3,750 % fällig am 08.08.2031		900	733	0,14
Seagate HDD Cayman				
4,125 % fällig am 15.01.2031		325	267	0,05
9,625 % fällig am 01.12.2032		460	508	0,10
Seazen Group Ltd.				
4,450 % fällig am 13.07.2025		1.000	520	0,10
6,000 % fällig am 12.08.2024		200	143	0,03
Sunac China Holdings Ltd.				
5,950 % fällig am 26.04.2024 ^		900	135	0,02
6,500 % fällig am 09.07.2023 ^		700	109	0,02
6,650 % fällig am 03.08.2024 ^		800	118	0,02
7,000 % fällig am 09.07.2025 ^		1.000	151	0,03
7,250 % fällig am 14.06.2022 ^	$	3.300	$ 491	0,09
7,500 % fällig am 01.02.2024 ^		900	135	0,03
7,950 % fällig am 11.10.2023 ^		300	45	0,01
8,350 % fällig am 19.04.2023 ^		200	30	0,01
Trafford Centre Finance Ltd.				
5,402 % fällig am 28.07.2038	£	300	318	0,06
			10.646	2,04
Summe Cayman Inseln			10.894	2,09
CHINA				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
New Metro Global Ltd.				
4,800 % fällig am 15.12.2024	$	300	205	0,04
Yango Justice International Ltd.				
7,500 % fällig am 15.04.2024 ^		2.600	55	0,01
7,500 % fällig am 17.02.2025 ^		1.900	17	0,00
7,875 % fällig am 04.09.2024 ^		1.900	28	0,01
Summe China			305	0,06
KOLUMBIEN				
STAATSEMISSIONEN				
Colombia Government International Bond				
5,000 % fällig am 15.06.2045		3.300	2.306	0,44
ZYPERN				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Atrium Finance PLC				
2,625 % fällig am 05.09.2027	€	1.300	1.034	0,20
DÄNEMARK				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
TDC Net A/S				
5,056 % fällig am 31.05.2028		800	858	0,17
DOMINIKANISCHE REPUBLIK				
STAATSEMISSIONEN				
Dominican Republic Government International Bond				
6,500 % fällig am 15.02.2048	$	2.600	2.253	0,43
ECUADOR				
STAATSEMISSIONEN				
Ecuador Government International Bond				
0,000 % fällig am 31.07.2030 (e)		1.416	412	0,08
1,500 % fällig am 31.07.2040		1.026	321	0,06
5,500 % fällig am 31.07.2030		600	292	0,06
Summe Ecuador			1.025	0,20
ÄGYPTEN				
STAATSEMISSIONEN				
Egypt Government International Bond				
5,625 % fällig am 16.04.2030	€	500	304	0,06
6,375 % fällig am 11.04.2031		800	487	0,09
7,500 % fällig am 16.02.2061	$	3.000	1.512	0,29
8,500 % fällig am 31.01.2047		700	374	0,07
Summe Ägypten			2.677	0,51
FINNLAND				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Balder Finland Oyj				
1,375 % fällig am 24.05.2030	€	200	131	0,03
2,000 % fällig am 18.01.2031		100	65	0,01
Nokia Oyj				
6,625 % fällig am 15.05.2039	$	600	575	0,11
Summe Finnland			771	0,15
FRANKREICH				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Altice France S.A.				
3,375 % fällig am 15.01.2028	€	100	80	0,01
4,000 % fällig am 15.07.2029		900	707	0,14
4,250 % fällig am 15.10.2029		600	473	0,09
5,500 % fällig am 15.10.2029	$	1.600	1.146	0,22
BNP Paribas S.A.				
1,904 % fällig am 30.09.2028	$	2.800	$ 2.388	0,46
5,198 % fällig am 10.01.2030		500	484	0,09
CGG S.A.				
8,750 % fällig am 01.04.2027		300	251	0,05
Electricite de France S.A.				
9,125 % fällig am 15.03.2033 (g)		500	514	0,10
Loxam S.A.S.				
2,875 % fällig am 15.04.2026	€	200	203	0,04
Renault S.A.				
2,375 % fällig am 25.05.2026		1.800	1.821	0,35
TDF Infrastructure SASU				
1,750 % fällig am 01.12.2029		3.600	3.168	0,61
Ubisoft Entertainment S.A.				
0,878 % fällig am 24.11.2027		400	335	0,06
Summe Frankreich			11.570	2,22
DEUTSCHLAND				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Deutsche Bank AG				
3,547 % fällig am 18.09.2031	$	1.500	1.247	0,24
5,882 % fällig am 08.07.2031		1.700	1.490	0,29
IHO Verwaltungs GmbH (3,750 % bar oder 4,500 % PIK)				
3,750 % fällig am 15.09.2026 (c)	€	1.550	1.582	0,30
INEOS Styrolution Group GmbH				
2,250 % fällig am 16.01.2027		2.400	2.250	0,43
ZF Finance GmbH				
2,750 % fällig am 25.05.2027		1.200	1.169	0,22
			7.738	1,48
KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG				
SCUR-Alpha 1503 GmbH				
10,602 % fällig am 28.03.2030	$	499	473	0,09
Summe Deutschland			8.211	1,57
GHANA				
STAATSEMISSIONEN				
Ghana Government International Bond				
8,125 % fällig am 26.03.2032 ^		400	173	0,03
8,750 % fällig am 11.03.2061 ^		300	125	0,02
8,950 % fällig am 26.03.2051 ^		200	84	0,02
Summe Ghana			382	0,07
GUERNSEY, KANALINSELN				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Globalworth Real Estate Investments Ltd.				
3,000 % fällig am 29.03.2025	€	994	897	0,17
HONGKONG				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Fortune Star BVI Ltd.				
3,950 % fällig am 02.10.2026		1.600	1.205	0,23
Huarong Finance Co. Ltd.				
2,125 % fällig am 30.09.2023	$	400	395	0,08
Summe Hongkong			1.600	0,31
INDONESIEN				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Perusahaan Perseroan Persero PT Perusahaan Listrik Negara				
1,875 % fällig am 05.11.2031	€	500	415	0,08
6,150 % fällig am 21.05.2048	$	1.000	968	0,18
			1.383	0,26
STAATSEMISSIONEN				
Indonesia Government International Bond				
1,100 % fällig am 12.03.2033	€	2.000	1.624	0,31
1,400 % fällig am 30.10.2031		700	608	0,12
			2.232	0,43
Summe Indonesien			3.615	0,69

BESCHREIBUNG		PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
IRLAND				
FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE				
Aurium CLO DAC				
3,907 % fällig am 16.01.2031	€	300	$ 321	0,06
Bain Capital Euro CLO DAC				
3,940 % fällig am 20.01.2032		1.988	2.122	0,41
GoldenTree Loan Management EUR CLO DAC				
4,100 % fällig am 20.01.2032		200	213	0,04
Harvest CLO DAC				
4,027 % fällig am 15.01.2032		2.500	2.670	0,51
Laurelin DAC				
3,920 % fällig am 20.10.2031		1.100	1.178	0,23
Palmerston Park CLO DAC				
3,825 % fällig am 18.04.2030		265	285	0,06
Sculptor European CLO DAC				
3,916 % fällig am 14.01.2032		800	857	0,16
Toro European CLO DAC				
3,995 % fällig am 12.01.2032		300	321	0,06
4,133 % fällig am 15.02.2034		750	796	0,15
			8.763	1,68
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
ABH Financial Ltd. Via Alfa Holding Issuance PLC				
2,700 % fällig am 11.06.2023 ^		2.800	458	0,09
Bank of Ireland Group PLC				
6,253 % fällig am 16.09.2026	$	700	696	0,13
			1.154	0,22
KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG				
Setanta Aircraft Leasing DAC				
7,538 % fällig am 05.11.2028		4.000	4.005	0,77
Summe Irland			13.922	2,67
ITALIEN				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Banca Monte dei Paschi di Siena SpA				
2,625 % fällig am 28.04.2025	€	900	922	0,18
8,000 % fällig am 22.01.2030		2.700	2.649	0,51
Intesa Sanpaolo SpA				
5,148 % fällig am 10.06.2030	£	100	103	0,02
5,500 % fällig am 01.03.2028 (g)(i)	€	750	686	0,13
Mundys SpA				
1,625 % fällig am 03.02.2025		300	313	0,06
1,875 % fällig am 12.02.2028		5.000	4.664	0,89
SpA				
2,125 % fällig am 30.04.2029 (k)		2.600	2.371	0,45
UniCredit SpA				
7,296 % fällig am 02.04.2034	$	900	849	0,16
7,830 % fällig am 04.12.2023		4.900	4.929	0,95
Summe Italien			17.486	3,35
ELFENBEINKÜSTE				
STAATSEMISSIONEN				
Ivory Coast Government International Bond				
5,750 % fällig am 31.12.2032		2.985	2.792	0,54
JAPAN				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Nissan Motor Co. Ltd.				
4,345 % fällig am 17.09.2027		3.200	2.913	0,56
4,810 % fällig am 17.09.2030		200	175	0,03
Summe Japan			3.088	0,59
JERSEY, KANALINSELN				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
AA Bond Co. Ltd.				
5,500 % fällig am 31.07.2050	£	2.200	2.440	0,47
Adient Global Holdings Ltd.				
3,500 % fällig am 15.08.2024	€	45	48	0,01
Corsair International Ltd.				
7,772 % fällig am 28.01.2027		1.600	1.737	0,33
8,122 % fällig am 28.01.2029		600	650	0,12
G City Europe Ltd.				
4,250 % fällig am 11.09.2025	€	1.800	$ 1.718	0,33
Summe Jersey, Kanalinseln			6.593	1,26
KASACHSTAN				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
KazMunayGas National Co. JSC				
6,375 % fällig am 24.10.2048	$	400	343	0,07
		AKTIEN		
LUXEMBURG				
STAMMAKTIEN				
Adler Group S.A. (d)		3.908	2	0,00
Adler Group S.A.		8.653	5	0,00
DrillCo Holding Lux S.A. (d)		130	2	0,00
DrillCo Holding Lux S.A. (d)(j)		61.666	1.185	0,23
Intelsat Emergence S.A. (d)(j)		14.398	331	0,06
Summe Stammaktien			1.525	0,29
		PAR (000S)		
WANDELANLEIHEN & WECHSEL				
Corestate Capital Holding S.A.				
1,375 % fällig am 31.07.2023 ^	€	2.000	318	0,06
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Albion Financing SARL				
5,250 % fällig am 15.10.2026		1.300	1.339	0,26
6,125 % fällig am 15.10.2026	$	500	470	0,09
Altice Financing S.A.				
5,750 % fällig am 15.08.2029		3.000	2.327	0,45
Altice France Holding S.A.				
6,000 % fällig am 15.02.2028		700	342	0,06
Aroundtown S.A.				
5,375 % fällig am 21.03.2029		1.200	889	0,17
Constellation Oil Services Holding S.A. (3,000 % bar und 4,000 % PIK)				
3,000 % fällig am 31.12.2026 (c)		147	87	0,02
Corestate Capital Holding S.A.				
3,500 % fällig am 31.07.2023 ^	€	3.500	539	0,10
CPI Property Group S.A.				
1,500 % fällig am 27.01.2031		1.000	595	0,11
1,750 % fällig am 14.01.2030		1.400	927	0,18
Cromwell Ereit Lux Finco SARL				
2,125 % fällig am 19.11.2025		400	377	0,07
FORESEA Holding S.A.				
7,500 % fällig am 15.06.2030	$	638	558	0,11
Gazprom PJSC Via Gaz Capital S.A.				
4,250 % fällig am 06.04.2024 ^	£	1.900	2.137	0,41
Greensaif Pipelines Bidco SARL				
6,129 % fällig am 23.02.2038	$	1.100	1.125	0,21
Intelsat Jackson Holdings S.A.				
6,500 % fällig am 15.03.2030		1.072	979	0,19
Logicor Financing SARL				
3,250 % fällig am 13.11.2028	€	1.000	934	0,18
Tierra Mojada Luxembourg SARL				
5,750 % fällig am 01.12.2040	$	2.011	1.722	0,33
			15.347	2,94
KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG				
Albion Financing SARL				
7,792 % fällig am 17.08.2026	€	2.000	2.179	0,42
Intelsat Jackson Holdings S.A.				
9,443 % fällig am 01.02.2029	$	265	264	0,05
			2.443	0,47
		AKTIEN		
RECHTE				
Intelsat Jackson Holdings S.A. - Exp. 05.12.2025		3.012	18	0,01
Summe Luxemburg			19.651	3,77
MAZEDONIEN				
STAATSEMISSIONEN				
North Macedonia Government International Bond				
2,750 % fällig am 18.01.2025	€	300	$ 312	0,06
MEXIKO				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Petroleos Mexicanos				
5,625 % fällig am 23.01.2046	$	1.416	814	0,16
6,350 % fällig am 12.02.2048		700	424	0,08
6,625 % fällig am 15.06.2035		4.800	3.351	0,64
6,750 % fällig am 21.09.2047		3.700	2.327	0,45
7,690 % fällig am 23.01.2050		1.384	939	0,18
Trust Fibra Uno				
6,390 % fällig am 15.01.2050		300	238	0,04
			8.093	1,55
STAATSEMISSIONEN				
Mexico Government International Bond				
3,771 % fällig am 24.05.2061		1.600	1.092	0,21
5,400 % fällig am 09.02.2028		2.800	2.854	0,55
			3.946	0,76
Summe Mexiko			12.039	2,31
MULTINATIONAL				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Allied Universal Holdco LLC				
3,625 % fällig am 01.06.2028	€	1.700	1.490	0,28
Connect Finco SARL				
6,750 % fällig am 01.10.2026	$	1.000	972	0,19
Summe multinational			2.462	0,47
NIEDERLANDE				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
ASR Nederland NV				
7,000 % fällig am 07.12.2043	€	100	114	0,02
Athora Netherlands NV				
7,000 % fällig am 19.06.2025 (g)(i)		200	206	0,04
CTP NV				
0,500 % fällig am 21.06.2025		100	97	0,02
1,500 % fällig am 27.09.2031		100	76	0,02
Imperial Brands Finance Netherlands BV				
1,750 % fällig am 18.03.2033		2.000	1.581	0,30
ING Groep NV				
6,500 % fällig am 16.04.2025 (g)(i)	$	1.300	1.214	0,23
6,750 % fällig am 16.04.2024 (g)(i)		600	574	0,11
NE Property BV				
3,375 % fällig am 14.07.2027	€	1.500	1.471	0,28
NN Group NV				
4,500 % fällig am 15.01.2026 (g)		1.100	1.162	0,22
Q-Park Holding BV				
3,500 % fällig am 01.02.2025		2.600	2.656	0,51
Syngenta Finance NV				
4,892 % fällig am 24.04.2025	$	1.276	1.250	0,24
United Group BV				
5,250 % fällig am 01.02.2030	€	600	520	0,10
Volkswagen International Finance NV				
3,500 % fällig am 17.06.2025 (g)		900	924	0,18
ZF Europe Finance BV				
2,000 % fällig am 23.02.2026		100	99	0,02
			11.944	2,29
KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG				
WP/AP Telecom Holdings BV				
7,498 % fällig am 30.03.2029		2.900	3.128	0,60
Summe Niederlande			15.072	2,89
NIGERIA				
STAATSEMISSIONEN				
Nigeria Government International Bond				
7,625 % fällig am 28.11.2047	$	1.300	928	0,18
7,696 % fällig am 23.02.2038		400	301	0,06
7,875 % fällig am 16.02.2032		1.800	1.514	0,29
Summe Nigeria			2.743	0,53

BESCHREIBUNG		PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
OMAN				
STAATSEMISSIONEN				
Oman Government International Bond				
6,750 % fällig am 17.01.2048	$	1.600	$ 1.541	0,30
PERU				
STAATSEMISSIONEN				
Peru Government International Bond				
8,750 % fällig am 21.11.2033		1.000	1.271	0,24
RUMÄNIEN				
STAATSEMISSIONEN				
Romania Government International Bond				
2,000 % fällig am 14.04.2033	€	600	464	0,09
2,875 % fällig am 13.04.2042		600	403	0,08
5,000 % fällig am 27.09.2026		2.000	2.192	0,42
Summe Rumänien			3.059	0,59
RUSSLAND				
STAATSEMISSIONEN				
Russia Government International Bond				
4,250 % fällig am 23.06.2027 ^	$	600	261	0,05
5,250 % fällig am 23.06.2047 ^		200	89	0,02
5,250 % fällig am 23.06.2047 ^		1.400	84	0,01
Summe Russland			434	0,08
SAUDI-ARABIEN				
STAATSEMISSIONEN				
Saudi Arabia Government International Bond				
3,450 % fällig am 02.02.2061		1.400	987	0,19
4,500 % fällig am 26.10.2046		1.200	1.054	0,20
4,875 % fällig am 18.07.2033		2.500	2.501	0,48
Summe Saudi-Arabien			4.542	0,87
SERBIEN				
STAATSEMISSIONEN				
Serbia Government International Bond				
6,500 % fällig am 26.09.2033		1.000	983	0,19
SLOWENIEN				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Nova Kreditna Banka Maribor d.d.				
1,875 % fällig am 27.01.2025	€	1.000	1.055	0,20
Nova Ljubljanska Banka d.d.				
3,400 % fällig am 05.02.2030		600	557	0,11
Summe Slowenien			1.612	0,31
SÜDAFRIKA				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
AngloGold Ashanti Holdings PLC				
3,750 % fällig am 01.10.2030	$	200	172	0,03
STAATSEMISSIONEN				
South Africa Government International Bond				
5,650 % fällig am 27.09.2047		1.200	852	0,17
Summe Südafrika			1.024	0,20
SPANIEN				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A.				
6,000 % fällig am 15.01.2026 (g)(i)	€	800	821	0,16
6,138 % fällig am 14.09.2028	$	600	602	0,11
Banco de Sabadell S.A.				
5,375 % fällig am 08.09.2026	€	1.700	1.846	0,35
Lorca Telecom Bondco S.A.				
4,000 % fällig am 18.09.2027		300	299	0,06
Summe Spanien			3.568	0,68
SRI LANKA				
STAATSEMISSIONEN				
Sri Lanka Government International Bond				
7,550 % fällig am 28.03.2030 ^	$	1.000	461	0,09
7,850 % fällig am 14.03.2029 ^		600	276	0,05
Summe Sri Lanka			737	0,14

BESCHREIBUNG		PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
SCHWEDEN				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Volvo Car AB				
4,250 % fällig am 31.05.2028	€	2.000	$ 2.100	0,40
SCHWEIZ				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Credit Suisse AG				
6,500 % fällig am 08.08.2023 (i)	$	2.800	2.790	0,54
UBS Group AG				
4,282 % fällig am 09.01.2028		700	647	0,12
Summe Schweiz			3.437	0,66
TÜRKEI				
STAATSEMISSIONEN				
Turkey Government International Bond				
4,875 % fällig am 16.04.2043		1.200	773	0,15
5,750 % fällig am 11.05.2047		4.900	3.361	0,64
Summe Türkei			4.134	0,79
UKRAINE				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
NPC Ukrenergo				
6,875 % fällig am 09.11.2028 ^		800	172	0,03
STAATSEMISSIONEN				
Ukraine Government International Bond				
4,375 % fällig am 27.01.2032 ^	€	4.400	1.049	0,20
6,750 % fällig am 20.06.2028 ^		200	47	0,01
8,994 % fällig am 01.02.2026 ^	$	300	76	0,02
			1.172	0,23
Summe Ukraine			1.344	0,26
VEREINIGTE ARABISCHE EMIRATE				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
DAE Sukuk Difc Ltd.				
3,750 % fällig am 15.02.2026		900	856	0,16
GROSSBRITANNIEN				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
AGPS BondCo PLC				
4,625 % fällig am 14.01.2026 ^	€	100	43	0,01
5,000 % fällig am 27.04.2027 ^		500	194	0,04
5,500 % fällig am 13.11.2026 ^		500	209	0,04
Barclays PLC				
5,875 % fällig am 15.09.2024 (g)(i)	£	200	228	0,04
7,750 % fällig am 15.09.2023 (g)(i)	$	600	589	0,11
Bellis Acquisition Co. PLC				
3,250 % fällig am 16.02.2026	£	2.100	2.241	0,43
Greene King Finance PLC				
5,106 % fällig am 15.03.2034		267	299	0,06
HSBC Holdings PLC				
2,804 % fällig am 24.05.2032	$	300	243	0,05
2,848 % fällig am 04.06.2031		200	166	0,03
3,973 % fällig am 22.05.2030		600	539	0,10
4,041 % fällig am 13.03.2028		300	281	0,06
5,210 % fällig am 11.08.2028		1.600	1.566	0,30
John Lewis PLC				
4,250 % fällig am 18.12.2034	£	400	317	0,06
6,125 % fällig am 21.01.2025		300	367	0,07
Lloyds Banking Group PLC				
4,976 % fällig am 11.08.2033	$	400	374	0,07
Market Bidco Finco PLC				
4,750 % fällig am 04.11.2027	€	1.500	1.322	0,25
Mitchells & Butlers Finance PLC				
5,451 % fällig am 15.12.2030	£	194	229	0,04
6,002 % fällig am 15.12.2030	$	777	715	0,14
6,469 % fällig am 15.09.2032	£	332	368	0,07
NatWest Group PLC				
6,000 % fällig am 29.12.2025 (g)(i)	$	1.700	1.577	0,30
Pinnacle Bidco PLC				
5,500 % fällig am 15.02.2025	€	100	105	0,02
6,375 % fällig am 15.02.2025	£	200	243	0,05

BESCHREIBUNG		PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
Santander UK Group Holdings PLC				
3,823 % fällig am 03.11.2028	$	1.500	$ 1.352	0,26
6,750 % fällig am 24.06.2024 (g)(i)	£	700	835	0,16
Virgin Media Secured Finance PLC				
4,250 % fällig am 15.01.2030		2.300	2.308	0,44
Virgin Money UK PLC				
4,000 % fällig am 03.09.2027		1.400	1.558	0,30
			18.268	3,50
NON-AGENCY-MBS				
Towd Point Mortgage Funding PLC				
5,635 % fällig am 20.10.2051		1.635	2.081	0,40
Summe Großbritannien			20.349	3,90
USA				
FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE				
Aames Mortgage Investment Trust				
5,930 % fällig am 25.10.2035	$	104	102	0,02
6,350 % fällig am 25.06.2035		11	10	0,00
Accredited Mortgage Loan Trust				
5,870 % fällig am 25.09.2035		101	99	0,02
ACE Securities Corp. Home Equity Loan Trust				
5,520 % fällig am 25.02.2037		2.455	1.065	0,20
5,750 % fällig am 25.02.2036		67	66	0,01
Ameriquest Mortgage Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates				
5,855 % fällig am 25.11.2035		61	60	0,01
8,525 % fällig am 25.11.2032 ^		479	468	0,09
Argent Securities Trust				
5,470 % fällig am 25.05.2036		567	141	0,03
Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust				
4,705 % fällig am 25.12.2035		9	9	0,00
6,155 % fällig am 25.06.2035		504	483	0,09
6,950 % fällig am 25.07.2034		21	21	0,00
Carrington Mortgage Loan Trust				
5,410 % fällig am 25.02.2037		716	648	0,12
6,200 % fällig am 25.05.2035		280	268	0,05
Countrywide Asset-Backed Certificates				
6,250 % fällig am 25.05.2047 ^		796	604	0,12
Countrywide Asset-Backed Certificates Trust				
3,221 % fällig am 25.03.2036		68	66	0,01
5,330 % fällig am 25.11.2047 ^		537	508	0,10
5,630 % fällig am 25.02.2037 ^		1.600	1.426	0,27
5,675 % fällig am 25.08.2036		2.100	2.001	0,38
5,990 % fällig am 25.10.2047		1.854	1.762	0,34
6,200 % fällig am 25.11.2034		63	62	0,01
6,725 % fällig am 25.11.2034		133	130	0,03
Countrywide Asset-Backed Certificates, Inc.				
5,710 % fällig am 25.04.2034		176	157	0,03
Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp.				
4,599 % fällig am 25.01.2032		3	3	0,00
Ellington Loan Acquisition Trust				
6,200 % fällig am 25.05.2037		323	304	0,06
First Franklin Mortgage Loan Trust				
6,425 % fällig am 25.07.2034		136	133	0,03
Fremont Home Loan Trust				
5,690 % fällig am 25.04.2036		282	251	0,05
6,080 % fällig am 25.06.2035 ^		700	620	0,12
GSAA Home Equity Trust				
5,270 % fällig am 25.11.2036		75	19	0,00
GSAMP Trust				
5,200 % fällig am 25.12.2046		24	12	0,00
5,240 % fällig am 25.01.2037		42	24	0,00
5,630 % fällig am 25.06.2036		196	104	0,02
5,630 % fällig am 25.08.2036		568	450	0,09
5,885 % fällig am 25.09.2035 ^		79	76	0,01
Home Equity Asset Trust				
6,245 % fällig am 25.05.2035		63	62	0,01
Home Equity Mortgage Loan Asset-Backed Trust				
5,530 % fällig am 25.06.2036		20	20	0,00
JPMorgan Mortgage Acquisition Trust				
3,815 % fällig am 25.07.2036		158	155	0,03
5,340 % fällig am 25.03.2047		88	86	0,02
5,410 % fällig am 25.06.2037		49	49	0,01
5,450 % fällig am 25.07.2036		647	290	0,06
5,450 % fällig am 25.03.2037		400	359	0,07

BESCHREIBUNG		PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
Long Beach Mortgage Loan Trust				
5,690 % fällig am 25.05.2046	$	554	$ 177	0,03
5,750 % fällig am 25.02.2036		894	736	0,14
MASTR Asset-Backed Securities Trust				
5,350 % fällig am 25.08.2036		3.719	1.180	0,23
5,450 % fällig am 25.03.2036		1.035	923	0,18
5,900 % fällig am 25.12.2034 ^		12	11	0,00
5,930 % fällig am 25.02.2034		453	436	0,08
6,050 % fällig am 25.04.2034		92	87	0,02
Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust				
5,290 % fällig am 25.05.2037		195	140	0,03
5,470 % fällig am 25.09.2036		235	105	0,02
5,730 % fällig am 25.01.2035		560	555	0,11
5,855 % fällig am 25.01.2035		290	273	0,05
7,050 % fällig am 25.02.2047		121	101	0,02
Morgan Stanley Dean Witter Capital, Inc. Trust				
6,725 % fällig am 25.11.2032		6	5	0,00
New Century Home Equity Loan Trust				
8,150 % fällig am 25.01.2033 ^		186	159	0,03
NovaStar Mortgage Funding Trust				
5,310 % fällig am 25.09.2037		214	211	0,04
Option One Mortgage Loan Trust				
5,370 % fällig am 25.01.2037		256	147	0,03
5,885 % fällig am 25.08.2035		26	26	0,01
Park Place Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates				
6,200 % fällig am 25.09.2034		21	20	0,00
6,950 % fällig am 25.12.2034		473	466	0,09
Renaissance Home Equity Loan Trust				
5,340 % fällig am 25.01.2037		1.336	470	0,09
Residential Asset Securities Corp. Trust				
5,609 % fällig am 25.01.2034		30	29	0,01
5,840 % fällig am 25.11.2035		78	77	0,01
5,855 % fällig am 25.09.2035		651	609	0,12
Saxon Asset Securities Trust				
5,615 % fällig am 25.03.2036		303	289	0,06
Securitized Asset-Backed Receivables LLC Trust				
5,330 % fällig am 25.07.2036		87	31	0,01
5,825 % fällig am 25.01.2035		19	18	0,00
Soundview Home Loan Trust				
5,615 % fällig am 25.06.2036 ^		4.818	3.958	0,76
Structured Asset Investment Loan Trust				
5,530 % fällig am 25.03.2036		87	84	0,02
5,780 % fällig am 25.11.2035		287	275	0,05
Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust				
6,150 % fällig am 25.08.2037		114	112	0,02
Structured Asset Securities Corp. Trust				
5,840 % fällig am 25.09.2035		222	210	0,04
Truman Capital Mortgage Loan Trust				
5,410 % fällig am 25.03.2036		374	369	0,07
WaMu Asset-Backed Certificates WaMu Trust				
5,300 % fällig am 25.01.2037		171	141	0,03
			25.603	4,91

	AKTIEN		
STAMMAKTIEN			
ENERGIE			
Constellation Oil Services Holding S.A. 'B' (d)(j)	161.700	18	0,00

		PAR (000S)		
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
American Airlines Pass-Through Trust				
3,000 % fällig am 15.04.2030	$	70	62	0,01
3,150 % fällig am 15.08.2033		84	73	0,01
3,200 % fällig am 15.12.2029		558	500	0,10
3,350 % fällig am 15.04.2031		219	195	0,04
3,375 % fällig am 01.11.2028		360	323	0,06
3,575 % fällig am 15.07.2029		276	256	0,05
3,650 % fällig am 15.12.2029		70	60	0,01
3,650 % fällig am 15.08.2030		213	196	0,04
3,700 % fällig am 01.04.2028		55	50	0,01
American Tower Corp.				
3,950 % fällig am 15.03.2029		700	646	0,12
Amgen, Inc.				
5,650 % fällig am 02.03.2053		600	608	0,12
AT&T, Inc.				
3,800 % fällig am 01.12.2057		800	580	0,11

BESCHREIBUNG		PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
Aviation Capital Group LLC				
3,500 % fällig am 01.11.2027	$	600	$ 530	0,10
5,500 % fällig am 15.12.2024		800	783	0,15
BAT Capital Corp.				
3,557 % fällig am 15.08.2027		100	92	0,02
Boeing Co.				
3,950 % fällig am 01.08.2059		500	370	0,07
5,705 % fällig am 01.05.2040		500	499	0,10
British Airways Pass-Through Trust				
4,250 % fällig am 15.05.2034		104	95	0,02
Broadcom, Inc.				
3,137 % fällig am 15.11.2035		508	390	0,08
3,187 % fällig am 15.11.2036		1.015	768	0,15
Charter Communications Operating LLC				
3,850 % fällig am 01.04.2061		1.200	727	0,14
CommScope, Inc.				
4,750 % fällig am 01.09.2029		2.200	1.737	0,33
Community Health Systems, Inc.				
8,000 % fällig am 15.03.2026		300	292	0,06
Crown Castle, Inc.				
2,100 % fällig am 01.04.2031		700	561	0,11
2,250 % fällig am 15.01.2031		800	653	0,13
5,000 % fällig am 11.01.2028		700	688	0,13
DAE Funding LLC				
3,375 % fällig am 20.03.2028		600	541	0,10
DISH DBS Corp.				
5,750 % fällig am 01.12.2028		800	597	0,11
DISH Network Corp.				
11,750 % fällig am 15.11.2027		675	659	0,13
Elevance Health, Inc.				
4,750 % fällig am 15.02.2033		600	583	0,11
Energy Transfer LP				
7,500 % fällig am 01.07.2038		2.000	2.195	0,42
EnLink Midstream LLC				
5,375 % fällig am 01.06.2029		300	286	0,06
EQT Corp.				
3,625 % fällig am 15.05.2031		400	345	0,07
Ford Motor Credit Co. LLC				
1,744 % fällig am 19.07.2024	€	300	317	0,06
2,330 % fällig am 25.11.2025		2.400	2.461	0,47
2,386 % fällig am 17.02.2026		300	308	0,06
2,700 % fällig am 10.08.2026	$	700	626	0,12
3,021 % fällig am 06.03.2024	€	1.100	1.186	0,23
3,375 % fällig am 13.11.2025	$	300	279	0,05
4,174 % fällig am 01.12.2024	€	1.700	1.832	0,35
Fortress Transportation & Infrastructure Investors LLC				
5,500 % fällig am 01.05.2028	$	1.400	1.283	0,25
6,500 % fällig am 01.10.2025		1.237	1.220	0,23
Freedom Mortgage Corp.				
6,625 % fällig am 15.01.2027		1.100	953	0,18
Global Atlantic Fin Co.				
4,400 % fällig am 15.10.2029		1.000	844	0,16
GLP Capital LP				
5,750 % fällig am 01.06.2028		300	294	0,06
Haleon U.S. Capital LLC				
3,375 % fällig am 24.03.2029		600	546	0,11
HCA, Inc.				
5,500 % fällig am 01.06.2033		1.000	999	0,19
IQVIA, Inc.				
5,700 % fällig am 15.05.2028		600	595	0,11
Kinder Morgan Energy Partners LP				
6,500 % fällig am 01.02.2037		400	413	0,08
6,950 % fällig am 15.01.2038		200	215	0,04
Las Vegas Sands Corp.				
3,200 % fällig am 08.08.2024		500	485	0,09
3,500 % fällig am 18.08.2026		600	559	0,11
3,900 % fällig am 08.08.2029		300	268	0,05
Medline Borrower LP				
3,875 % fällig am 01.04.2029		500	435	0,08
5,250 % fällig am 01.10.2029		500	434	0,08
Midwest Connector Capital Co. LLC				
3,900 % fällig am 01.04.2024		100	98	0,02
National Fuel Gas Co.				
5,200 % fällig am 15.07.2025		200	196	0,04
Netflix, Inc.				
4,875 % fällig am 15.06.2030		1.400	1.379	0,26

BESCHREIBUNG		PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
Newell Brands, Inc.				
6,000 % fällig am 01.04.2046	$	400	$ 317	0,06
NGPL PipeCo LLC				
7,768 % fällig am 15.12.2037		1.400	1.497	0,29
Noble Finance LLC				
8,000 % fällig am 15.04.2030		450	458	0,09
NuStar Logistics LP				
5,625 % fällig am 28.04.2027		1.400	1.347	0,26
Occidental Petroleum Corp.				
6,625 % fällig am 01.09.2030		700	728	0,14
7,875 % fällig am 15.09.2031		1.700	1.898	0,36
Organon & Co.				
2,875 % fällig am 30.04.2028	€	3.500	3.324	0,63
Pacific Gas & Electric Co.				
3,150 % fällig am 01.01.2026	$	400	371	0,07
3,300 % fällig am 15.03.2027 ^		100	91	0,02
3,300 % fällig am 01.08.2040		1.800	1.215	0,23
3,450 % fällig am 01.07.2025		200	189	0,04
3,500 % fällig am 15.06.2025 ^		100	95	0,02
3,750 % fällig am 01.07.2028		200	179	0,03
4,450 % fällig am 15.04.2042 ^		100	76	0,01
4,500 % fällig am 01.07.2040		850	662	0,13
4,550 % fällig am 01.07.2030		200	181	0,03
4,600 % fällig am 15.06.2043 ^		200	152	0,03
4,650 % fällig am 01.08.2028		300	278	0,05
Piper Sandler Cos.				
5,200 % fällig am 15.10.2023		600	598	0,12
Plains All American Pipeline LP				
5,150 % fällig am 01.06.2042		1.500	1.247	0,24
6,650 % fällig am 15.01.2037		200	201	0,04
PRA Group, Inc.				
8,375 % fällig am 01.02.2028		700	635	0,12
RLJ Lodging Trust LP				
3,750 % fällig am 01.07.2026		200	184	0,04
Rockies Express Pipeline LLC				
4,800 % fällig am 15.05.2030		700	612	0,12
4,950 % fällig am 15.07.2029		300	275	0,05
Sirius XM Radio, Inc.				
4,125 % fällig am 01.07.2030		800	654	0,13
Southern California Edison Co.				
4,000 % fällig am 01.04.2047		200	159	0,03
Spirit AeroSystems, Inc.				
9,375 % fällig am 30.11.2029		100	107	0,02
Sprint Capital Corp.				
6,875 % fällig am 15.11.2028		1.385	1.469	0,28
Standard Industries, Inc.				
2,250 % fällig am 21.11.2026	€	1.800	1.749	0,34
T-Mobile USA, Inc.				
2,550 % fällig am 15.02.2031	$	400	333	0,06
4,950 % fällig am 15.03.2028		500	492	0,09
Tallgrass Energy Partners LP				
5,500 % fällig am 15.01.2028		500	458	0,09
6,000 % fällig am 31.12.2030		300	265	0,05
Time Warner Cable LLC				
5,875 % fällig am 15.11.2040		500	441	0,08
U.S. Airways Pass-Through Trust				
3,950 % fällig am 15.05.2027		164	153	0,03
United Airlines Pass-Through Trust				
2,900 % fällig am 01.11.2029		85	74	0,01
3,450 % fällig am 01.06.2029		132	121	0,02
3,450 % fällig am 07.01.2030		142	123	0,02
3,500 % fällig am 01.09.2031		157	142	0,03
4,150 % fällig am 11.10.2025		254	250	0,05
5,875 % fällig am 15.04.2029		2.372	2.354	0,45
Venture Global Calcasieu Pass LLC				
6,250 % fällig am 15.01.2030		1.000	993	0,19
Venture Global LNG, Inc.				
8,125 % fällig am 01.06.2028		2.200	2.237	0,43
Verizon Communications, Inc.				
2,355 % fällig am 15.03.2032		2.200	1.770	0,34
VICI Properties LP				
3,500 % fällig am 15.02.2025		200	191	0,04
WMG Acquisition Corp.				
3,000 % fällig am 15.02.2031		1.100	891	0,17
XPO, Inc.				
6,250 % fällig am 01.06.2028		500	493	0,09

BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
Zayo Group Holdings, Inc.			
4,000 % fällig am 01.03.2027	$ 300	$ 212	0,04
		68.106	13,05
KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG			
Adient U.S. LLC			
8,334 % fällig am 10.04.2028	1	1	0,00
Avolon TLB Borrower (U.S.) LLC			
7,396 % fällig am 01.12.2027	2.145	2.145	0,41
CenturyLink, Inc.			
7,467 % fällig am 15.03.2027	3.729	2.888	0,56
Charter Communications Operating LLC			
6,795 % - 6,834 % fällig am 01.02.2027	5.188	5.163	0,99
CommScope, Inc.			
8,443 % fällig am 06.04.2026	481	462	0,09
Level 3 Financing, Inc.			
6,967 % fällig am 01.03.2027	1.626	1.519	0,29
Standard Industries, Inc.			
7,692 % fällig am 22.09.2028	1.313	1.314	0,25
		13.492	2,59
NON-AGENCY-MBS			
Banc of America Alternative Loan Trust			
5,550 % fällig am 25.01.2037 ^	84	65	0,01
Banc of America Funding Trust			
4,416 % fällig am 20.01.2047 ^	42	39	0,01
BCAP LLC Trust			
6,250 % fällig am 26.08.2036	1.928	897	0,17
Bear Stearns Adjustable Rate Mortgage Trust			
6,800 % fällig am 25.02.2036	6	6	0,00
Citigroup Mortgage Loan Trust			
3,620 % fällig am 25.10.2046 ^	20	18	0,00
5,410 % fällig am 25.10.2035	63	59	0,01
Countrywide Alternative Loan Trust			
5,456 % fällig am 25.01.2036	10	10	0,00
5,550 % fällig am 25.07.2036 ^	3	1	0,00
5,577 % fällig am 20.05.2046 ^	279	237	0,05
5,650 % fällig am 25.04.2036	555	209	0,04
6,000 % fällig am 25.05.2036 ^	137	75	0,01
6,000 % fällig am 25.02.2037 ^	852	379	0,07
6,000 % fällig am 25.04.2037 ^	198	115	0,02
Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust			
4,085 % fällig am 25.03.2037 ^	8	7	0,00
4,936 % fällig am 25.04.2046 ^	17	5	0,00
5,690 % fällig am 25.04.2046	1.715	499	0,10
6,000 % fällig am 25.12.2036 ^	334	145	0,03
6,000 % fällig am 25.07.2037	66	25	0,01
6,500 % fällig am 25.11.2036 ^	107	41	0,01
Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp.			
6,500 % fällig am 25.04.2033	0	0	0,00
Credit Suisse Mortgage Capital Certificates			
3,387 % fällig am 26.04.2038	75	72	0,01
3,616 % fällig am 27.09.2035	98	83	0,02
First Horizon Mortgage Pass-Through Trust			
4,267 % fällig am 25.09.2035	12	11	0,00
HarborView Mortgage Loan Trust			
5,597 % fällig am 19.05.2035	149	136	0,03
5,637 % fällig am 19.06.2035	3	3	0,00

BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
5,697 % fällig am 20.10.2045	$ 291	$ 259	0,05
5,777 % fällig am 19.11.2035	3	2	0,00
HSI Asset Securitization Corp. Trust			
5,590 % fällig am 25.11.2035	1.396	1.306	0,25
IndyMac Mortgage Loan Trust			
3,103 % fällig am 25.06.2037 ^	10	9	0,00
3,677 % fällig am 25.12.2036 ^	2	2	0,00
5,510 % fällig am 25.07.2047	54	37	0,01
Lehman Mortgage Trust			
6,000 % fällig am 25.09.2037 ^	102	94	0,02
Luminent Mortgage Trust			
5,550 % fällig am 25.10.2046	675	603	0,12
Merrill Lynch Mortgage Investors Trust			
4,459 % fällig am 25.05.2036	3	3	0,00
5,810 % fällig am 25.11.2029	1	1	0,00
Morgan Stanley Mortgage Loan Trust			
4,148 % fällig am 25.03.2036 ^	31	20	0,00
Nomura Asset Acceptance Corp. Alternative Loan Trust			
4,937 % fällig am 25.08.2035	1	1	0,00
Residential Accredit Loans, Inc. Trust			
5,550 % fällig am 25.05.2047	59	53	0,01
Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust			
5,590 % fällig am 25.06.2037	197	174	0,03
Structured Asset Mortgage Investments Trust			
5,550 % fällig am 25.05.2036	446	358	0,07
5,570 % fällig am 25.09.2047 ^	569	471	0,09
SunTrust Alternative Loan Trust			
5,750 % fällig am 25.12.2035 ^	2	2	0,00
Thornburg Mortgage Securities Trust			
6,400 % fällig am 25.06.2037 ^	11	10	0,00
WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust			
5,176 % fällig am 25.11.2042	5	5	0,00
Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates Trust			
4,022 % fällig am 25.09.2036 ^	126	37	0,01
		6.584	1,26
US-REGIERUNGSBEHÖRDEN			
Uniform Mortgage-Backed Security			
5,500 % fällig am 01.12.2052	954	950	0,18
Uniform Mortgage-Backed Security, TBA			
5,000 % fällig am 01.08.2053	10.100	9.899	1,90
5,500 % fällig am 01.08.2053	9.400	9.354	1,79
6,000 % fällig am 01.08.2053	4.200	4.236	0,81
6,500 % fällig am 01.07.2053	6.200	6.331	1,22
		30.770	5,90
Summe USA		144.573	27,71
VENEZUELA			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Petroleos de Venezuela S.A.			
6,000 % fällig am 16.05.2024 ^	1.600	62	0,01
STAATSEMISSIONEN			
Venezuela Government International Bond			
6,000 % fällig am 09.12.2020 ^	241	15	0,00
7,000 % fällig am 31.03.2038 ^	1.528	134	0,03
7,750 % fällig am 13.10.2019 ^	1.900	114	0,02
		263	0,05
Summe Venezuela		325	0,06

BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
KURZFRISTIGE INSTRUMENTE			
KURZFRISTIGE SCHULDTITEL			
Corestate Capital Holding S.A.			
15,000 % fällig am 31.07.2023 (j)	€ 200	$ 220	0,04
ARGENTINA TREASURY BILLS			
(28,578) % fällig am 18.10.2023 (e)(f)	ARS 843	2	0,00
(12,549) % fällig am 23.11.2023 (e)(f)	823	2	0,00
		4	0,00
U.S. TREASURY BILLS			
5,238 % fällig am 17.08.2023 (b)(e)(f)(l)	$ 8.500	8.445	1,62
Summe kurzfristige Instrumente		8.669	1,66
Summe Übertragbare Wertpapiere		**$ 359.563**	**68,93**
	AKTIEN		
INVESTMENTFONDS			
ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN			
PIMCO Funds: Global Investors Series plc - Asia Strategic Interest Bond Fund (h)	250.000	2.235	0,43
PIMCO Funds: Global Investors Series plc - PIMCO Asia High Yield Bond Fund (h)	651.264	5.920	1,13
PIMCO Funds: Global Investors Series plc - PIMCO European High Yield Bond Fund (h)	538.168	6.095	1,17
PIMCO Funds: Global Investors Series plc - US Short-Term Fund (h)	3.624.810	36.393	6,98
PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (h)	19.218	191	0,04
		50.834	9,75
BÖRSENGEHANDELTE FONDS			
PIMCO ETFs plc - PIMCO US Dollar Short Maturity UCITS ETF (h)	5.570	553	0,10
Summe Investmentfonds		**$ 51.387**	**9,85**

PENSIONSGESCHÄFTE

Kontrahent	Kredit-zins	Abrechnungs-datum	Fälligkeits-datum	Kapital-betrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensions-geschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensions-geschäft[1]	% des Nettovermögens
BOS	5,170 %	30.06.2023	03.07.2023	$ 91.100	U.S. Treasury Bonds 3,250 % fällig am 15.05.2042	$ (93.785)	$ 91.100	$ 91.139	17,47
BPS	5,100	30.06.2023	03.07.2023	100	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 %, fällig am 15.01.2030	(102)	100	100	0,02
	5,160	30.06.2023	03.07.2023	7.100	U.S. Treasury Notes 2,000 % fällig am 15.08.2025	(7.251)	7.100	7.103	1,36
	5,170	30.06.2023	03.07.2023	5.800	Ginnie Mae 2,500 % fällig am 20.10.2051	(6.004)	5.800	5.802	1,11
FICC	2,400	30.06.2023	03.07.2023	3.266	U.S. Treasury Notes 4,625 % fällig am 30.06.2025	(3.331)	3.266	3.266	0,63
Summe Pensionsgeschäfte						**$ (110.473)**	**$ 107.366**	**$ 107.410**	**20,59**

[1] Umfasst aufgelaufene Zinsen.

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

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

FUTURES

Beschreibung	Art	Ablauf-monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Euro-Bund 10-Year Bond September Futures	Long	09.2023	24	$ (33)	(0,01)
U.S. Treasury 2-Year Note September Futures	Long	09.2023	344	(983)	(0,19)
U.S. Treasury 5-Year Note September Futures	Long	09.2023	242	(482)	(0,09)
U.S. Treasury 10-Year Note September Futures	Long	09.2023	556	(1.095)	(0,21)
U.S. Treasury 30-Year Bond September Futures	Long	09.2023	117	32	0,01
U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond September Futures	Long	09.2023	201	329	0,06
United Kingdom Long Gilt September Futures	Long	09.2023	23	(24)	0,00
				$ (2.256)	(0,43)
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate				**$ (2.256)**	**(0,43)**

ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)

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

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMMISSIONEN - SCHUTZVERKAUF[1]

Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag[2]	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
AT&T, Inc.	1,000 %	20.06.2026	$ 1.900	$ (19)	0,00
AT&T, Inc.	1,000	20.06.2028	300	2	0,00
Boeing Co.	1,000	20.12.2026	500	2	0,00
CCO Holdings LLC	5,000	20.12.2027	1.000	4	0,00
Ford Motor Credit Co. LLC	5,000	20.06.2027	1.000	26	0,01
Glencore Finance Europe Ltd.	5,000	20.12.2025	€ 3.300	(390)	(0,08)
Marks & Spencer PLC	1,000	20.12.2024	4.100	222	0,04
Rolls-Royce PLC	1,000	20.12.2024	4.000	(13)	0,00
				$ (166)	(0,03)

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES - SCHUTZVERKAUF[1]

Index/Tranchen	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag[2]	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
CDX.HY-39 5-Year Index	5,000 %	20.12.2027	$ 4.455	$ 162	0,03
CDX.HY-40 5-Year Index	5,000	20.06.2028	33.600	942	0,18
CDX.IG-40 5-Year Index	1,000	20.06.2028	26.400	198	0,04
				$ 1.302	0,25

ZINSSWAPS

Zahlung/ Erhalt variabel Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Erhalt[3]	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	3,750 %	20.09.2028	£ 13.300	$ 851	0,16
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,050	15.12.2031	¥ 940.000	(32)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	0,000	16.09.2023	$ 22.300	(318)	(0,06)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	0,000	17.09.2023	33.800	(463)	(0,09)
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,000	15.06.2027	67.100	70	0,01
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,000	16.12.2030	22.300	4.150	0,80
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,250	17.06.2025	33.800	3.959	0,76
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,750	15.06.2032	20.600	(151)	(0,03)
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,750	15.06.2052	14.000	(16)	0,00
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,750	21.06.2053	30.200	1.787	0,34
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,000	21.06.2033	56.400	2.531	0,49
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,250	21.06.2028	82.400	2.675	0,51
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,500	21.06.2026	27.700	(429)	(0,08)
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,750	21.06.2025	55.700	1.219	0,23
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	0,000	16.09.2023	22.300	320	0,06
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	0,000	17.09.2023	33.800	465	0,09
Erhalt[3]	6-Month EUR-EURIBOR	2,500	20.09.2053	€ 2.000	(27)	(0,01)
Erhalt[3]	6-Month EUR-EURIBOR	3,000	20.09.2028	34.500	(115)	(0,02)
Erhalt[3]	6-Month EUR-EURIBOR	3,000	20.09.2033	2.100	(23)	0,00
Erhalt[3]	6-Month EUR-EURIBOR	3,500	20.09.2025	26.800	(9)	0,00
					$ 16.444	3,15
Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate					**$ 17.580**	**3,37**

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

(2) Der maximal mögliche Betrag, den der Fonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

(3) Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft.

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

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

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMMISSIONEN - SCHUTZVERKAUF[1]

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag[2]	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Markt-wert	% des Nettovermögens
BOA	South Africa Government International Bond	1,000 %	20.06.2028	$ 2.000	$ (174)	$ 34	$ (140)	(0,03)
BRC	Indonesia Government International Bond	1,000	20.06.2031	5.500	(236)	122	(114)	(0,02)
GST	ADLER Real Estate AG	5,000	20.12.2026	€ 700	(5)	(168)	(173)	(0,03)
JPM	Hochtief AG	5,000	20.12.2026	2.700	643	(262)	381	0,07
					$ 228	$ (274)	$ (46)	(0,01)

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

(2) Der maximal mögliche Betrag, den der Fonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	08.2023	$ 5.057	€ 4.647	$ 23	$ 0	$ 23	0,01
BPS	07.2023	123.254	112.489	0	(529)	(529)	(0,10)
	08.2023	€ 113.365	$ 124.367	532	(17)	515	0,10
	08.2023	$ 9.906	€ 9.061	12	(12)	0	0,00
BRC	08.2023	3.528	3.258	34	0	34	0,01
	08.2023	714	£ 563	2	0	2	0,00
CBK	08.2023	€ 3.047	$ 3.297	0	(34)	(34)	(0,01)
	08.2023	£ 15.761	19.655	0	(388)	(388)	(0,07)
	08.2023	$ 1.929	€ 1.776	13	(1)	12	0,00
GLM	07.2023	BRL 2.961	$ 550	0	(64)	(64)	(0,01)
	07.2023	$ 615	BRL 2.970	1	0	1	0,00
	09.2023	BRL 3.003	$ 615	0	(1)	(1)	0,00
JPM	08.2023	£ 399	496	0	(12)	(12)	0,00
	08.2023	$ 1.433	£ 1.131	6	0	6	0,00
MBC	08.2023	10.058	€ 9.115	0	(93)	(93)	(0,02)
MYI	07.2023	149	137	0	0	0	0,00
	07.2023	1.407	£ 1.115	11	0	11	0,00
	08.2023	¥ 33.066	$ 249	18	0	18	0,01
	08.2023	$ 456	€ 421	4	0	4	0,00
RBC	08.2023	276	£ 219	2	0	2	0,00
	08.2023	98	MXN 1.707	0	0	0	0,00
RYL	08.2023	€ 2.879	$ 3.120	0	(28)	(28)	(0,01)
SCX	08.2023	2.917	3.203	14	0	14	0,00
	08.2023	$ 564	£ 455	15	0	15	0,00
SOG	07.2023	€ 112.489	$ 121.009	0	(1.717)	(1.717)	(0,33)
SSB	09.2023	$ 322	BRL 1.634	13	0	13	0,00
TOR	08.2023	¥ 15.229	$ 115	9	0	9	0,00
UAG	08.2023	$ 1.343	€ 1.238	11	0	11	0,00
	08.2023	1.252	£ 991	8	0	8	0,00
				$ 728	$ (2.896)	$ (2.168)	(0,42)

ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklassen Institutional EUR (Hedged) thesaurierend, Institutional EUR (Hedged) ausschüttend II, Class E EUR (Hedged) thesaurierend und Class E EUR (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2023	€ 123	$ 134	$ 0	$ 0	$ 0	0,00
	07.2023	$ 52.328	€ 48.691	793	0	793	0,15
BPS	07.2023	€ 48.084	$ 52.685	225	0	225	0,04
	07.2023	$ 52.299	€ 48.649	777	0	777	0,15
	08.2023	52.470	47.820	0	(227)	(227)	(0,04)
CBK	07.2023	€ 49.186	$ 53.491	8	(179)	(171)	(0,03)
	07.2023	$ 94	€ 87	2	0	2	0,00
	08.2023	50.210	46.117	173	0	173	0,03
JPM	07.2023	€ 47.687	$ 52.069	43	0	43	0,01
	08.2023	$ 52.142	€ 47.687	0	(44)	(44)	(0,01)

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
MBC	07.2023	€ 1.079	$ 1.165	$ 1	$ (13)	$ (12)	0,00
	07.2023	$ 31	€ 29	1	0	1	0,00
SOG	07.2023	52.268	48.588	742	0	742	0,14
				$ 2.765	$ (463)	$ 2.302	0,44

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklassen Institutional GBP (Hedged) thesaurierend und Institutional GBP (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BPS	07.2023	$ 91.940	£ 74.332	$ 2.563	$ 0	$ 2.563	0,49
BRC	07.2023	£ 149	$ 189	0	0	0	0,00
	07.2023	$ 2	£ 1	0	0	0	0,00
CBK	07.2023	£ 146	$ 183	0	(3)	(3)	0,00
	07.2023	$ 10	£ 8	0	0	0	0,00
JPM	07.2023	£ 75.705	$ 95.722	0	(527)	(527)	(0,10)
	08.2023	$ 95.742	£ 75.705	525	0	525	0,10
MBC	07.2023	£ 45	$ 58	0	0	0	0,00
	07.2023	$ 93.623	£ 75.625	2.523	0	2.523	0,49
MYI	07.2023	93.094	74.903	2.134	0	2.134	0,41
TOR	07.2023	£ 75.975	$ 96.541	0	(49)	(49)	(0,01)
	08.2023	$ 96.562	£ 75.975	48	0	48	0,01
				$ 7.793	$ (579)	$ 7.214	1,39

Summe Freiverkehrsfinanzderivate	**$ 7.302**	**1,40**
Summe Anlagen	**$ 540.942**	**103,71**
Sonstige Aktiva und Passiva	**$ (19.375)**	**(3,71)**
Nettovermögen	**$ 521.567**	**100,00**

ERLÄUTERUNGEN ZUR AUFSTELLUNG DES WERTPAPIERBESTANDS (Angaben in Tausend*):

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

^ **Das Wertpapier ist in Verzug.**

(a) **Bei dem Wertpapier handelt es sich um ein Interest Only- („IO“) bzw. IO-Strip.**

(b) **Wertpapier per Emissionstermin.**

(c) **Wertpapier mit Sachwertausschüttung.**

(d) **Das Wertpapier hat in den letzten zwölf Monaten keine Erträge geliefert.**

(e) **Nullkuponwertpapier.**

(f) **Der Kupon stellt eine Rendite bis zur Endfälligkeit dar.**

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

(h) **Mit dem Fonds verbunden.**

(i) **Bedingt wandelbares Wertpapier.**

(i) **Eingeschränkte Wertpapiere (31. Dezember 2022: 0,17 %):**

Emittentenbeschreibung	Kauf-datum	Kosten	Markt-wert	% des Nettovermögens
Constellation Oil Services Holding S.A. ‘B’	10.06.2022	$ 18	$ 18	0,00
Corestate Capital Holding S.A. 15,000 %, fällig am 31.07.2023	06.12.2022	210	220	0,04
DrillCo Holding Lux S.A.	08.06.2023	1.233	1.185	0,23
Intelsat Emergence S.A.	24.02.2020 - 01.05.2020	1.289	331	0,06
		$ 2.750	$ 1.754	0,33

(k) **Wertpapier mit einem gesamten beizulegenden Zeitwert von 365 USD (31. Dezember 2022: null USD) wurden zum 30. Juni 2023 gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte als Sicherheit verpfändet.**

(l) **Wertpapier mit einem gesamten beizulegenden Zeitwert von 391 USD (31. Dezember 2022: null USD) und Barmittel in Höhe von 740 USD (31. Dezember 2022: 1.278 USD) wurden zum 30. Juni 2023 gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. als Sicherheit für Finanzderivate verpfändet.**

Barmittel in Höhe von 27.426 USD (31. Dezember 2022: 19.045 USD) wurden zum 30. Juni 2023 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Beizulegender Zeitwert[1]

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 30. Juni 2023 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie[2]	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	$ 5	$ 356.569	$ 2.989	$ 359.563
Investmentfonds	51.387	0	0	51.387
Pensionsgeschäfte	0	107.366	0	107.366
Finanzderivate[3]	(57)	22.683	0	22.626
Summen	**$ 51.335**	**$ 486.618**	**$ 2.989**	**$ 540.942**

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

Kategorie[2]	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	$ 0	$ 399.799	$ 1.785	$ 401.584
Investmentfonds	55.254	552	0	55.806
Pensionsgeschäfte	0	102.832	0	102.832
Finanzderivate[3]	1.425	12.723	0	14.148
Summen	**$ 56.679**	**$ 515.906**	**$ 1.785**	**$ 574.370**

(1) Siehe Erläuterung 3 in den Erläuterungen zum Abschluss für weitere Informationen.

(2) Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung des Wertpapierbestands.

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

Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2023:

Kontrahent	Kredit-zins	Abrechnungs-datum	Fälligkeits-datum	Kredit-betrag	Verbindlichkeiten aus umgekehrten Pensions-geschäften	% des Nettovermögens
JML	2,500 %	06.06.2023	TBD[1]	€ (337)	$ (368)	(0,07)
Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte					**$ (368)**	**(0,07)**

(1) Umgekehrtes Pensionsgeschäft mit offener Laufzeit.

Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC-Finanzderivate und -Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2023 und 31. Dezember 2022:

	Zum 30. Jun. 2023			Zum 31. Dez. 2022		
Kontrahent	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-Engagement[1]	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Nettoengagement[1]
AZD	$ k. A.	$ k. A.	$ k. A.	$ (14)	$ 0	$ (14)
BOA	676	(470)	206	(31)	0	(31)
BPS	3.324	(2.750)	574	104	0	104
BRC	(78)	0	(78)	(270)	208	(62)
CBK	(409)	391	(18)	1.636	(1.510)	126
GLM	(64)	20	(44)	(204)	270	66
GST	(173)	0	(173)	(179)	0	(179)
JPM	372	(410)	(38)	27	(80)	(53)
MBC	2.419	(1.790)	629	(1.015)	800	(215)
MYI	2.167	(1.550)	617	4	(28)	(24)
RBC	2	0	2	k. A.	k. A.	k. A.
RYL	(28)	0	(28)	k. A.	k. A.	k. A.
SCX	29	0	29	1.547	(1.450)	97
SOG	(975)	720	(255)	k. A.	k. A.	k. A.
SSB	13	0	13	k. A.	k. A.	k. A.
TOR	8	(10)	(2)	65	(120)	(55)
UAG	19	0	19	26	0	26

(1) Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären.

Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung des Wertpapierbestands zum 30. Juni 2023:

	30. Jun. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	43,25	38,87
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	25,45	30,57
Sonstige übertragbare Wertpapiere	0,23	1,69
Investmentfonds	9,85	9,88
Pensionsgeschäfte	20,59	18,21
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	(0,43)	0,25
Zentral abgerechnete Finanzderivate	3,37	1,95
Freiverkehrsfinanzderivate	1,40	0,30
Umgekehrte Pensionsgeschäfte	(0,07)	k. A.

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 30. Juni 2023 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	30. Jun. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
Argentinien	0,65	0,45
Weissrussland	k. A.	0,05
Bermuda	0,70	0,54
Brasilien	0,00	0,00
Kanada	0,59	0,42
Cayman-Inseln	2,09	2,11
Chile	k. A.	0,09
China	0,06	0,08
Kolumbien	0,44	0,40
Zypern	0,20	0,17
Dänemark	0,17	0,15
Dominikanische Republik	0,43	0,38
Ecuador	0,20	0,24
Ägypten	0,51	0,59
Finnland	0,15	0,09
Frankreich	2,22	3,32
Deutschland	1,57	3,45
Ghana	0,07	0,06
Guernsey, Kanalinseln	0,17	0,43
Hongkong	0,31	1,08
Indien	k. A.	0,05
Indonesien	0,69	0,45
Irland	2,67	2,38
Italien	3,35	4,15
Elfenbeinküste	0,54	k. A.
Japan	0,59	1,11
Jersey, Kanalinseln	1,26	1,16
Kasachstan	0,07	k. A.
Luxemburg	3,77	5,22
Mazedonien	0,06	0,05
Mauritius	k. A.	0,13
Mexiko	2,31	1,67
Multinational	0,47	0,42
Niederlande	2,89	3,96
Nigeria	0,53	0,44
Oman	0,30	0,27
Peru	0,24	k. A.
Katar	k. A.	0,22
Rumänien	0,59	0,14
Russland	0,08	0,14
Saudi-Arabien	0,87	k. A.
Serbien	0,19	k. A.
Slowenien	0,31	0,27
Südafrika	0,20	0,07
Spanien	0,68	0,62
Sri Lanka	0,14	0,09
Schweden	0,40	0,35
Schweiz	0,66	0,58
Türkei	0,79	0,85
Ukraine	0,26	0,20
Vereinigte Arabische Emirate	0,16	0,15
Großbritannien	3,90	4,30
USA	27,71	22,26
Jungferninseln (Britisch)	k. A.	0,08
Venezuela	0,06	0,07
Kurzfristige Instrumente	1,66	5,18
Investmentfonds	9,85	9,88
Pensionsgeschäfte	20,59	18,21
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	(0,43)	0,25
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen - Schutzverkauf	(0,03)	(0,12)
Credit Default Swaps auf Kreditindizes — Schutzverkauf	0,25	0,23
Zinsswaps	3,15	1,84
Freiverkehrsfinanzderivate		
Verkaufsoptionen		
Credit Default Swaptions auf Kreditindizes	k. A.	0,00
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen - Schutzverkauf	(0,01)	(0,01)
Devisenterminkontrakte	(0,42)	(0,46)
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	1,83	0,77
Sonstige Aktiva und Passiva	(3,71)	(1,72)
Nettovermögen	100,00	100,00

BESCHREIBUNG		PARI (000S)		MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE					
ARGENTINIEN					
STAATSEMISSIONEN					
Argentina Government International Bond					
3,500 % fällig am 09.07.2041	$	900	$	290	0,50
AUSTRALIEN					
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL					
FMG Resources Pty. Ltd.					
4,375 % fällig am 01.04.2031		200		171	0,30
BERMUDA					
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL					
NCL Corp. Ltd.					
8,375 % fällig am 01.02.2028		200		209	0,36
BRASILIEN					
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL					
Banco BTG Pactual S.A.					
2,750 % fällig am 11.01.2026		100		91	0,16
STAATSEMISSIONEN					
Brazil Government International Bond					
5,000 % fällig am 27.01.2045		200		157	0,27
Summe Brasilien				248	0,43
KANADA					
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL					
Air Canada Pass-Through Trust					
5,250 % fällig am 01.10.2030		411		399	0,69
B.C. Unlimited Liability Co.					
4,000 % fällig am 15.10.2030		350		300	0,52
				699	1,21
CAYMAN INSELN					
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL					
Avolon Holdings Funding Ltd.					
2,528 % fällig am 18.11.2027		100		84	0,14
Seagate HDD Cayman					
3,125 % fällig am 15.07.2029		50		39	0,07
5,750 % fällig am 01.12.2034		200		178	0,31
				301	0,52
CHILE					
STAATSEMISSIONEN					
Chile Government International Bond					
3,100 % fällig am 07.05.2041		300		226	0,39
KOLUMBIEN					
STAATSEMISSIONEN					
Colombia Government International Bond					
5,000 % fällig am 15.06.2045		300		210	0,36
7,500 % fällig am 02.02.2034		300		294	0,51
				504	0,87
COSTA RICA					
STAATSEMISSIONEN					
Costa Rica Government International Bond					
5,625 % fällig am 30.04.2043		250		215	0,37
DÄNEMARK					
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL					
TDC Net A/S					
5,618 % fällig am 06.02.2030	€	300		321	0,55
DOMINIKANISCHE REPUBLIK					
STAATSEMISSIONEN					
Dominican Republic Government International Bond					
4,500 % fällig am 30.01.2030	$	300		264	0,45
6,500 % fällig am 15.02.2048		400		346	0,60
				610	1,05
ECUADOR					
STAATSEMISSIONEN					
Ecuador Government International Bond					
2,500 % fällig am 31.07.2035	$	400	$	140	0,24
ÄGYPTEN					
STAATSEMISSIONEN					
Egypt Government International Bond					
6,375 % fällig am 11.04.2031	€	400		243	0,42
FINNLAND					
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL					
Nokia Oyj					
3,125 % fällig am 15.05.2028		100		103	0,18
4,375 % fällig am 21.08.2031		100		108	0,18
				211	0,36
FRANKREICH					
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL					
Accor S.A.					
2,375 % fällig am 29.11.2028		100		98	0,17
Altice France S.A.					
5,125 % fällig am 15.07.2029	$	300		213	0,36
AXA S.A.					
5,500 % fällig am 11.07.2043	€	100		109	0,19
Chrome Bidco SASU					
3,500 % fällig am 31.05.2028		200		184	0,32
Crown European Holdings S.A.					
2,875 % fällig am 01.02.2026		100		105	0,18
Forvia					
2,375 % fällig am 15.06.2029		200		179	0,31
JCDecaux SE					
5,000 % fällig am 11.01.2029		100		110	0,19
Loxam S.A.S.					
4,500 % fällig am 15.02.2027		100		105	0,18
Societe Generale S.A.					
6,691 % fällig am 10.01.2034	$	200		204	0,35
Vilmorin & Cie S.A.					
1,375 % fällig am 26.03.2028	€	100		86	0,15
				1.393	2,40
DEUTSCHLAND					
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL					
Deutsche Bank AG					
1,625 % fällig am 20.01.2027		100		97	0,17
1,875 % fällig am 23.02.2028		100		97	0,17
3,742 % fällig am 07.01.2033	$	200		147	0,25
Fraport AG Frankfurt Airport Services Worldwide					
1,875 % fällig am 31.03.2028	€	50		48	0,08
Schaeffler AG					
3,375 % fällig am 12.10.2028		100		100	0,17
ZF Finance GmbH					
2,000 % fällig am 06.05.2027		100		95	0,17
				584	1,01
HONGKONG					
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL					
Lenovo Group Ltd.					
6,536 % fällig am 27.07.2032	$	200		202	0,35
UNGARN					
STAATSEMISSIONEN					
Hungary Government International Bond					
2,125 % fällig am 22.09.2031		200		155	0,27
6,750 % fällig am 25.09.2052		200		207	0,35
				362	0,62
INDIEN					
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL					
ReNew Power Pvt Ltd.					
5,875 % fällig am 05.03.2027		275		258	0,44
INDONESIEN					
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL					
Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia					
4,700 % fällig am 06.06.2032	$	500	$	496	0,86
IRLAND					
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL					
Bank of Ireland Group PLC					
6,253 % fällig am 16.09.2026		200		199	0,34
GE Capital UK Funding Unlimited Co.					
5,875 % fällig am 18.01.2033	£	50		61	0,11
Perrigo Finance Unlimited Co.					
4,650 % fällig am 15.06.2030	$	200		177	0,30
				437	0,75
ITALIEN					
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL					
Intesa Sanpaolo SpA					
8,248 % fällig am 21.11.2033		50		52	0,09
Mundys SpA					
1,875 % fällig am 12.02.2028	€	200		187	0,32
Nexi SpA					
2,125 % fällig am 30.04.2029		100		91	0,16
Telecom Italia SpA					
1,625 % fällig am 18.01.2029		100		84	0,14
				414	0,71
ELFENBEINKÜSTE					
STAATSEMISSIONEN					
Ivory Coast Government International Bond					
6,125 % fällig am 15.06.2033	$	100		88	0,15
JAPAN					
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL					
Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc.					
5,475 % fällig am 22.02.2031		200		199	0,34
Mizuho Financial Group, Inc.					
3,490 % fällig am 05.09.2027	€	300		319	0,55
Norinchukin Bank					
5,430 % fällig am 09.03.2028	$	200		202	0,35
Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc.					
2,472 % fällig am 14.01.2029		100		85	0,15
Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd.					
5,500 % fällig am 09.03.2028		200		202	0,35
				1.007	1,74
KASACHSTAN					
STAATSEMISSIONEN					
Kazakhstan Government International Bond					
6,500 % fällig am 21.07.2045		200		212	0,37
LIBERIA					
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL					
Royal Caribbean Cruises Ltd.					
4,250 % fällig am 01.07.2026		350		322	0,56
LUXEMBURG					
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL					
Altice Financing S.A.					
5,750 % fällig am 15.08.2029		200		155	0,27
Logicor Financing SARL					
1,625 % fällig am 17.01.2030	€	200		162	0,28
				317	0,55
MEXIKO					
STAATSEMISSIONEN					
Mexico Government International Bond					
4,875 % fällig am 19.05.2033	$	500		478	0,82
5,750 % fällig am 12.10.2110		175		157	0,27
				635	1,09

BESCHREIBUNG		PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
MAROKKO				
STAATSEMISSIONEN				
Morocco Government International Bond				
3,000 % fällig am 15.12.2032	$	200	$ 159	0,27
MULTINATIONAL				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Allied Universal Holdco LLC				
3,625 % fällig am 01.06.2028	€	100	88	0,15
American Airlines, Inc.				
5,500 % fällig am 20.04.2026	$	50	49	0,09
5,750 % fällig am 20.04.2029		300	291	0,50
Ardagh Packaging Finance PLC				
2,125 % fällig am 15.08.2026	€	200	195	0,34
NXP BV				
5,350 % fällig am 01.03.2026	$	50	50	0,09
			673	1,17
NIEDERLANDE				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
AerCap Holdings NV				
5,875 % fällig am 10.10.2079		200	189	0,32
Citycon Treasury BV				
1,625 % fällig am 12.03.2028	€	100	80	0,14
Cooperatieve Rabobank UA				
3,758 % fällig am 06.04.2033	$	300	261	0,45
CTP NV				
1,250 % fällig am 21.06.2029	€	100	79	0,13
Digital Dutch Finco BV				
1,000 % fällig am 15.01.2032		200	154	0,26
Enel Finance International NV				
2,250 % fällig am 12.07.2031	$	50	39	0,07
2,875 % fällig am 11.04.2029	£	300	317	0,55
ING Groep NV				
4,125 % fällig am 24.08.2033	€	100	103	0,18
JDE Peet's NV				
2,250 % fällig am 24.09.2031	$	50	39	0,07
NE Property BV				
3,375 % fällig am 14.07.2027	€	100	98	0,17
Prosus NV				
3,061 % fällig am 13.07.2031	$	200	157	0,27
Sensata Technologies BV				
4,000 % fällig am 15.04.2029		300	267	0,46
Universal Music Group NV				
4,000 % fällig am 13.06.2031	€	100	109	0,19
Wabtec Transportation Netherlands BV				
1,250 % fällig am 03.12.2027		50	47	0,08
			1.939	3,34
OMAN				
STAATSEMISSIONEN				
Oman Government International Bond				
6,000 % fällig am 01.08.2029	$	100	100	0,17
6,750 % fällig am 17.01.2048		200	193	0,34
			293	0,51
PANAMA				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Carnival Corp.				
4,000 % fällig am 01.08.2028		100	89	0,15
STAATSEMISSIONEN				
Panama Government International Bond				
6,700 % fällig am 26.01.2036		700	751	1,30
Summe Panama			840	1,45
PARAGUAY				
STAATSEMISSIONEN				
Paraguay Government International Bond				
5,400 % fällig am 30.03.2050		300	257	0,44

BESCHREIBUNG		PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
PERU				
STAATSEMISSIONEN				
Peru Government International Bond				
3,000 % fällig am 15.01.2034	$	200	$ 167	0,29
3,300 % fällig am 11.03.2041		400	309	0,53
			476	0,82
PHILIPPINEN				
STAATSEMISSIONEN				
Philippines Government International Bond				
5,500 % fällig am 17.01.2048		250	257	0,44
POLEN				
STAATSEMISSIONEN				
Poland Government International Bond				
4,875 % fällig am 04.10.2033		125	123	0,21
RUMÄNIEN				
STAATSEMISSIONEN				
Romania Government International Bond				
1,750 % fällig am 13.07.2030	€	100	84	0,14
6,625 % fällig am 27.09.2029		75	85	0,15
7,625 % fällig am 17.01.2053	$	200	220	0,38
			389	0,67
SERBIEN				
STAATSEMISSIONEN				
Serbia Government International Bond				
1,650 % fällig am 03.03.2033	€	200	146	0,25
SINGAPUR				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Flex Ltd.				
4,875 % fällig am 15.06.2029	$	50	48	0,08
SÜDAFRIKA				
STAATSEMISSIONEN				
South Africa Government International Bond				
4,850 % fällig am 30.09.2029		60	53	0,09
5,650 % fällig am 27.09.2047		60	42	0,07
5,750 % fällig am 30.09.2049		300	213	0,37
			308	0,53
SPANIEN				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Abertis Infraestructuras S.A.				
3,375 % fällig am 27.11.2026	£	100	113	0,19
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A.				
6,138 % fällig am 14.09.2028	$	200	201	0,35
Banco de Sabadell S.A.				
0,875 % fällig am 16.06.2028	€	100	92	0,16
CaixaBank S.A.				
3,750 % fällig am 07.09.2029		100	108	0,19
Cellnex Finance Co. S.A.				
2,000 % fällig am 15.09.2032		400	344	0,59
Grifols S.A.				
2,250 % fällig am 15.11.2027		300	297	0,51
			1.155	1,99
SCHWEDEN				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
EQT AB				
0,875 % fällig am 14.05.2031		300	233	0,40
GROSSBRITANNIEN				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Atlantica Sustainable Infrastructure PLC				
4,125 % fällig am 15.06.2028	$	250	223	0,38
Barclays PLC				
7,437 % fällig am 02.11.2033		200	216	0,37
Berkeley Group PLC				
2,500 % fällig am 11.08.2031	£	100	83	0,14

BESCHREIBUNG		PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
HSBC Holdings PLC				
3,973 % fällig am 22.05.2030	$	100	$ 90	0,16
Land Securities Capital Markets PLC				
4,875 % fällig am 15.09.2034	£	100	121	0,21
Lloyds Banking Group PLC				
7,500 % fällig am 27.06.2024 (a)(c)	$	50	48	0,08
Marks & Spencer PLC				
4,500 % fällig am 10.07.2027	£	100	113	0,20
National Grid PLC				
3,875 % fällig am 16.01.2029	€	300	325	0,56
NatWest Group PLC				
0,780 % fällig am 26.02.2030		400	348	0,60
Standard Chartered PLC				
0,800 % fällig am 17.11.2029		200	178	0,31
6,301 % fällig am 09.01.2029	$	50	50	0,09
Virgin Media Secured Finance PLC				
4,125 % fällig am 15.08.2030	£	100	99	0,17
Vmed O2 UK Financing PLC				
4,500 % fällig am 15.07.2031		200	194	0,33
Vodafone Group PLC				
5,125 % fällig am 04.06.2081	$	300	218	0,38
Weir Group PLC				
2,200 % fällig am 13.05.2026		200	179	0,31
			2.485	4,29
USA				
FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE				
GoodLeap Sustainable Home Solutions Trust				
5,520 % fällig am 22.02.2055		97	92	0,16
Home Equity Mortgage Loan Asset-Backed Trust				
5,450 % fällig am 25.08.2036		45	44	0,08
			136	0,24
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
AES Corp.				
2,450 % fällig am 15.01.2031		250	202	0,35
5,450 % fällig am 01.06.2028		150	147	0,25
Albertsons Cos., Inc.				
3,500 % fällig am 15.03.2029		100	87	0,15
Ally Financial, Inc.				
8,000 % fällig am 01.11.2031		140	145	0,25
AMC Networks, Inc.				
4,250 % fällig am 15.02.2029		100	54	0,09
American Tower Corp.				
2,900 % fällig am 15.01.2030		50	43	0,07
2,950 % fällig am 15.01.2051		200	126	0,22
Amgen, Inc.				
3,000 % fällig am 22.02.2029		450	407	0,70
AT&T, Inc.				
4,300 % fällig am 15.02.2030		300	285	0,49
Avantor Funding, Inc.				
3,875 % fällig am 01.11.2029		200	175	0,30
Aviation Capital Group LLC				
5,500 % fällig am 15.12.2024		50	49	0,08
Axalta Coating Systems LLC				
3,375 % fällig am 15.02.2029		200	170	0,29
Ball Corp.				
2,875 % fällig am 15.08.2030		400	332	0,57
Bank of America Corp.				
6,204 % fällig am 10.11.2028		600	617	1,06
Bank of New York Mellon Corp.				
4,706 % fällig am 01.02.2034		200	192	0,33
Beacon Roofing Supply, Inc.				
4,500 % fällig am 15.11.2026		200	190	0,33
Black Knight InfoServ LLC				
3,625 % fällig am 01.09.2028		300	269	0,46
Boise Cascade Co.				
4,875 % fällig am 01.07.2030		250	226	0,39
Builders FirstSource, Inc.				
4,250 % fällig am 01.02.2032		200	174	0,30
Cable One, Inc.				
4,000 % fällig am 15.11.2030		100	78	0,14
Catalent Pharma Solutions, Inc.				
3,125 % fällig am 15.02.2029		200	163	0,28

BESCHREIBUNG		PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
CCO Holdings LLC				
4,250 % fällig am 01.02.2031	$	100	$ 81	0,14
4,500 % fällig am 01.05.2032		275	220	0,38
CenterPoint Energy Houston Electric LLC				
5,300 % fällig am 01.04.2053		200	205	0,35
Charter Communications Operating LLC				
3,950 % fällig am 30.06.2062		200	123	0,21
Chobani LLC				
4,625 % fällig am 15.11.2028		300	273	0,47
Clearway Energy Operating LLC				
3,750 % fällig am 15.02.2031		275	228	0,39
Comcast Corp.				
4,650 % fällig am 15.02.2033		200	199	0,34
CommScope Technologies LLC				
6,000 % fällig am 15.06.2025		100	93	0,16
CommScope, Inc.				
4,750 % fällig am 01.09.2029		200	158	0,27
Community Health Systems, Inc.				
4,750 % fällig am 15.02.2031		200	151	0,26
Coty, Inc.				
5,000 % fällig am 15.04.2026		300	288	0,50
Covanta Holding Corp.				
4,875 % fällig am 01.12.2029		200	173	0,30
Credit Acceptance Corp.				
6,625 % fällig am 15.03.2026		200	192	0,33
Crocs, Inc.				
4,250 % fällig am 15.03.2029		50	43	0,07
Crown Castle, Inc.				
2,500 % fällig am 15.07.2031		300	247	0,43
3,100 % fällig am 15.11.2029		50	44	0,08
CVS Health Corp.				
3,750 % fällig am 01.04.2030		300	275	0,47
DaVita, Inc.				
4,625 % fällig am 01.06.2030		30	26	0,05
Dell International LLC				
3,375 % fällig am 15.12.2041		100	71	0,12
6,020 % fällig am 15.06.2026		50	51	0,09
DISH DBS Corp.				
5,250 % fällig am 01.12.2026		100	80	0,14
Edgewell Personal Care Co.				
5,500 % fällig am 01.06.2028		50	47	0,08
Elanco Animal Health, Inc.				
6,650 % fällig am 28.08.2028		200	195	0,34
Embecta Corp.				
5,000 % fällig am 15.02.2030		200	166	0,29
Equinix, Inc.				
2,500 % fällig am 15.05.2031		150	122	0,21
Ford Motor Co.				
3,250 % fällig am 12.02.2032		275	217	0,37
Frontier Communications Holdings LLC				
8,750 % fällig am 15.05.2030		48	47	0,08
Goldman Sachs Group, Inc.				
3,102 % fällig am 24.02.2033		100	85	0,15
Graphic Packaging International LLC				
3,500 % fällig am 01.03.2029		200	175	0,30
Haleon U.S. Capital LLC				
3,375 % fällig am 24.03.2029		350	318	0,55
HAT Holdings LLC				
3,375 % fällig am 15.06.2026		50	45	0,08
HCA, Inc.				
4,125 % fällig am 15.06.2029		350	324	0,56
Hilton Domestic Operating Co., Inc.				
3,625 % fällig am 15.02.2032		200	167	0,29
Hilton Grand Vacations Borrower Escrow LLC				
4,875 % fällig am 01.07.2031		200	168	0,29
Host Hotels & Resorts LP				
2,900 % fällig am 15.12.2031		250	197	0,34
Ingevity Corp.				
3,875 % fällig am 01.11.2028		50	43	0,07
IQVIA, Inc.				
2,250 % fällig am 15.01.2028	€	250	241	0,42
JPMorgan Chase & Co.				
2,580 % fällig am 22.04.2032	$	600	499	0,86
Kilroy Realty LP				
2,650 % fällig am 15.11.2033		200	136	0,24

BESCHREIBUNG		PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
Kraft Heinz Foods Co.				
3,750 % fällig am 01.04.2030	$	50	$ 46	0,08
6,500 % fällig am 09.02.2040		100	108	0,19
Lamb Weston Holdings, Inc.				
4,375 % fällig am 31.01.2032		200	179	0,31
Level 3 Financing, Inc.				
3,625 % fällig am 15.01.2029		50	30	0,05
LPL Holdings, Inc.				
4,000 % fällig am 15.03.2029		50	44	0,08
Marvell Technology, Inc.				
4,875 % fällig am 22.06.2028		50	49	0,08
Moody's Corp.				
2,000 % fällig am 19.08.2031		250	202	0,35
Morgan Stanley				
5,123 % fällig am 01.02.2029		330	326	0,56
MPH Acquisition Holdings LLC				
5,750 % fällig am 01.11.2028		100	75	0,13
MSCI, Inc.				
3,625 % fällig am 01.09.2030		50	43	0,07
National Rural Utilities Cooperative Finance Corp.				
1,350 % fällig am 15.03.2031		200	153	0,26
NCR Corp.				
5,125 % fällig am 15.04.2029		200	177	0,31
Netflix, Inc.				
4,875 % fällig am 15.06.2030		300	296	0,51
Newell Brands, Inc.				
6,000 % fällig am 01.04.2046		240	190	0,33
OneMain Finance Corp.				
3,500 % fällig am 15.01.2027		250	215	0,37
Open Text Holdings, Inc.				
4,125 % fällig am 15.02.2030		100	85	0,15
Organon & Co.				
2,875 % fällig am 30.04.2028	€	300	285	0,49
Owens & Minor, Inc.				
6,625 % fällig am 01.04.2030	$	200	182	0,31
Pacific Gas & Electric Co.				
6,700 % fällig am 01.04.2053		225	221	0,38
Park Intermediate Holdings LLC				
4,875 % fällig am 15.05.2029		100	86	0,15
PNC Financial Services Group, Inc.				
2,200 % fällig am 01.11.2024		300	285	0,49
Post Holdings, Inc.				
5,500 % fällig am 15.12.2029		300	277	0,48
Prime Security Services Borrower LLC				
6,250 % fällig am 15.01.2028		250	235	0,41
Quanta Services, Inc.				
2,350 % fällig am 15.01.2032		200	158	0,27
Ritchie Bros Holdings, Inc.				
7,750 % fällig am 15.03.2031		50	52	0,09
Rocket Mortgage LLC				
4,000 % fällig am 15.10.2033		200	157	0,27
Santander Holdings USA, Inc.				
5,807 % fällig am 09.09.2026		200	197	0,34
SBA Communications Corp.				
3,125 % fällig am 01.02.2029		500	424	0,73
Scripps Escrow, Inc.				
3,875 % fällig am 15.01.2029		100	81	0,14
Sirius XM Radio, Inc.				
3,875 % fällig am 01.09.2031		150	116	0,20
SLM Corp.				
3,125 % fällig am 02.11.2026		150	130	0,22
Southern California Edison Co.				
2,500 % fällig am 01.06.2031		500	416	0,72
Sprint Capital Corp.				
8,750 % fällig am 15.03.2032		400	483	0,84
Standard Industries, Inc.				
4,375 % fällig am 15.07.2030		200	173	0,30
T-Mobile USA, Inc.				
2,250 % fällig am 15.02.2026		100	92	0,16
TEGNA, Inc.				
5,000 % fällig am 15.09.2029		200	173	0,30
Tenet Healthcare Corp.				
4,625 % fällig am 15.06.2028		350	327	0,56
TerraForm Power Operating LLC				
5,000 % fällig am 31.01.2028		200	184	0,32

BESCHREIBUNG		PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
Topaz Solar Farms LLC				
5,750 % fällig am 30.09.2039	$	200	$ 196	0,34
TopBuild Corp.				
3,625 % fällig am 15.03.2029		250	218	0,38
Travel + Leisure Co.				
4,625 % fällig am 01.03.2030		250	212	0,37
Twilio, Inc.				
3,625 % fällig am 15.03.2029		200	170	0,29
Uber Technologies, Inc.				
4,500 % fällig am 15.08.2029		200	184	0,32
United Airlines Pass-Through Trust				
5,875 % fällig am 15.04.2029		72	71	0,12
United Airlines, Inc.				
4,625 % fällig am 15.04.2029		200	182	0,31
United Rentals North America, Inc.				
3,875 % fällig am 15.02.2031		200	173	0,30
Verizon Communications, Inc.				
1,500 % fällig am 18.09.2030		50	40	0,07
2,850 % fällig am 03.09.2041		300	214	0,37
VMware, Inc.				
2,200 % fällig am 15.08.2031		200	157	0,27
4,500 % fällig am 15.05.2025		50	49	0,08
Wells Fargo & Co.				
4,540 % fällig am 15.08.2026		100	98	0,17
Wisconsin Power & Light Co.				
4,950 % fällig am 01.04.2033		200	198	0,34
WMG Acquisition Corp.				
2,250 % fällig am 15.08.2031	€	400	348	0,60
Yum! Brands, Inc.				
4,625 % fällig am 31.01.2032	$	100	91	0,16
ZF North America Capital, Inc.				
7,125 % fällig am 14.04.2030		200	204	0,35
			20.301	35,01
NON-AGENCY-MBS				
Downey Savings & Loan Association Mortgage Loan Trust				
5,997 % fällig am 19.09.2044		29	26	0,04
US-REGIERUNGSBEHÖRDEN				
Uniform Mortgage-Backed Security				
5,000 % fällig am 01.04.2053		993	974	1,68
5,500 % fällig am 01.11.2052 - 01.05.2053		1.191	1.185	2,04
Uniform Mortgage-Backed Security, TBA				
5,000 % fällig am 01.08.2053		200	196	0,34
			2.355	4,06
US-SCHATZOBLIGATIONEN				
U.S. Treasury Bonds				
4,000 % fällig am 15.11.2042		175	174	0,30
Summe USA			22.992	39,65
URUGUAY				
STAATSEMISSIONEN				
Uruguay Government International Bond				
5,100 % fällig am 18.06.2050		400	399	0,69
Summe Übertragbare Wertpapiere			**$ 44.287**	**76,37**
		AKTIEN		
INVESTMENTFONDS				
ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN				
PIMCO Funds: Global Investors Series plc -Emerging Markets Bond ESG Fund (b)		344.725	3.582	6,17
PIMCO Funds: Global Investors Series plc - Global Investment Grade Credit ESG Fund (b)		147.887	1.482	2,56
Summe Investmentfonds			**$ 5.064**	**8,73**

PENSIONSGESCHÄFTE

Kontrahent	Kredit-zins	Abrechnungs-datum	Fälligkeits-datum	Kapital-betrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensions-geschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensions-geschäft[1]	% des Nettovermögens
MBC	5,160 %	30.06.2023	03.07.2023	$ 7.400	U.S. Treasury Notes 0,500 % fällig am 28.02.2026	$ (7.643)	$ 7.400	$ 7.403	12,76
Summe Pensionsgeschäfte						**$ (7.643)**	**$ 7.400**	**$ 7.403**	**12,76**

(1) Umfasst aufgelaufene Zinsen.

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

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

FUTURES

Beschreibung	Art	Ablauf-monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Canada Government 10-Year Bond September Futures	Long	09.2023	1	$ (2)	0,00
Euro-Bobl September Futures	Short	09.2023	7	12	0,02
Euro-Bund 10-Year Bond September Futures	Long	09.2023	6	(8)	(0,01)
Euro-Schatz September Futures	Short	09.2023	2	2	0,00
U.S. Treasury 2-Year Note September Futures	Long	09.2023	15	(46)	(0,08)
U.S. Treasury 5-Year Note September Futures	Long	09.2023	5	(10)	(0,02)
U.S. Treasury 10-Year Ultra September Futures	Short	09.2023	15	18	0,03
U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond September Futures	Long	09.2023	7	13	0,03
United Kingdom Long Gilt September Futures	Short	09.2023	1	1	0,00
				$ (20)	(0,03)
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate				**$ (20)**	**(0,03)**

ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)

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

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMMISSIONEN - SCHUTZVERKAUF[1]

Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag[2]	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
AT&T, Inc.	1,000 %	20.06.2028	$ 100	$ 0	0,00

ZINSSWAPS

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Zahlung	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	3,250 %	20.09.2053	£ 30	$ (3)	(0,01)
Zahlung	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	3,500	20.09.2033	100	(9)	(0,01)
Erhalt	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	3,750	20.09.2028	150	10	0,02
Erhalt	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	4,000	20.09.2025	150	5	0,01
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,400	15.06.2032	¥ 10.000	0	0,00
					$ 3	0,01
Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate					**$ 3**	**0,01**

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

(2) Der maximal mögliche Betrag, den der Fonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

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

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

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMMISSIONEN - SCHUTZVERKAUF[1]

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag[2]	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Markt-wert	% des Nettovermögens
BOA	Brazil Government International Bond	1,000 %	20.06.2028	$ 300	$ (17)	$ 7	$ (10)	(0,02)
	South Africa Government International Bond	1,000	20.06.2028	200	(16)	2	(14)	(0,02)
BRC	Indonesia Government International Bond	1,000	20.06.2028	300	0	2	2	0,00
	Turkey Government International Bond	1,000	20.12.2027	100	(17)	3	(14)	(0,02)
GST	Indonesia Government International Bond	1,000	20.06.2028	100	0	1	1	0,00

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag[2]	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Markt-wert	% des Nettovermögens
MYC	Brazil Government International Bond	1,000 %	20.12.2027	$ 150	$ (8)	$ 5	$ (3)	(0,01)
	Turkey Government International Bond	1,000	20.06.2028	200	(36)	6	(30)	(0,05)
					$ (94)	$ 26	$ (68)	(0,12)

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

(2) Der maximal mögliche Betrag, den der Fonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2023	€ 18.284	$ 19.650	$ 0	$ (298)	$ (298)	(0,51)
	08.2023	261	281	0	(4)	(4)	(0,01)
BRC	08.2023	14.342	15.424	0	(255)	(255)	(0,44)
	08.2023	£ 297	373	0	(5)	(5)	(0,01)
	08.2023	$ 149	€ 136	0	0	0	0,00
CBK	07.2023	18.992	17.468	66	0	66	0,11
	08.2023	€ 17.468	$ 19.018	0	(66)	(66)	(0,11)
MBC	08.2023	CAD 4	3	0	0	0	0,00
	08.2023	$ 20.005	€ 18.129	0	(185)	(185)	(0,32)
MYI	07.2023	43	39	0	0	0	0,00
	08.2023	€ 14.342	$ 15.424	0	(255)	(255)	(0,44)
	08.2023	£ 568	708	0	(14)	(14)	(0,02)
SCX	08.2023	$ 3.579	€ 3.271	0	(3)	(3)	0,00
	08.2023	105	£ 85	3	0	3	0,00
UAG	08.2023	£ 203	$ 256	0	(1)	(1)	0,00
	08.2023	$ 20.923	€ 19.058	0	(88)	(88)	(0,15)
				$ 69	$ (1.174)	$ (1.105)	(1,90)

ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklassen Institutional EUR (Hedged) thesaurierend und Class E EUR (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2023	€ 179	$ 194	$ 0	$ (1)	$ (1)	0,00
	07.2023	$ 15.822	€ 14.722	240	0	240	0,41
BRC	07.2023	€ 111	$ 121	0	(1)	(1)	0,00
	07.2023	$ 2	€ 2	0	0	0	0,00
CBK	07.2023	€ 15.272	$ 16.596	0	(64)	(64)	(0,11)
	08.2023	$ 15.970	€ 14.668	55	0	55	0,09
GLM	07.2023	310	290	7	0	7	0,01
MBC	07.2023	€ 95	$ 102	0	(1)	(1)	0,00
	07.2023	$ 15.906	€ 14.880	328	0	328	0,57
SCX	07.2023	15.922	14.878	310	0	310	0,53
UAG	07.2023	€ 77	$ 84	0	(1)	(1)	0,00
				$ 940	$ (68)	$ 872	1,50

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklasse Institutional GBP (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
MBC	07.2023	$ 79	£ 64	$ 2	$ 0	$ 2	0,01
MYI	07.2023	79	64	2	0	2	0,00
UAG	07.2023	81	65	2	0	2	0,00
				$ 6	$ 0	$ 6	0,01

Summe Freiverkehrsfinanzderivate	**$ (295)**	**(0,51)**
Summe Anlagen	**$ 56.439**	**97,33**
Sonstige Aktiva und Passiva	**$ 1.550**	**2,67**
Nettovermögen	**$ 57.989**	**100,00**

ERLÄUTERUNGEN ZUR AUFSTELLUNG DES WERTPAPIERBESTANDS (Angaben in Tausend*):

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

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

(b) Mit dem Fonds verbunden.

(c) Bedingt wandelbares Wertpapier.

Barmittel in Höhe von 222 USD (31. Dezember 2022: 113 USD) wurden zum 30. Juni 2023 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Barmittel in Höhe von 473 USD (31. Dezember 2022: null USD) wurden zum 30. Juni 2023 gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. als Sicherheit für Finanzderivate verpfändet.

Beizulegender Zeitwert[1]

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 30. Juni 2023 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie[2]	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	$ 0	$ 44.261	$ 26	$ 44.287
Investmentfonds	5.064	0	0	5.064
Pensionsgeschäfte	0	7.400	0	7.400
Finanzderivate[3]	5	(317)	0	(312)
Summen	**$ 5.069**	**$ 51.344**	**$ 26**	**$ 56.439**

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

Kategorie[2]	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	$ 0	$ 9.978	$ 0	$ 9.978
Finanzderivate[3]	41	(54)	0	(13)
Summen	**$ 41**	**$ 9.924**	**$ 0**	**$ 9.965**

(1) Siehe Erläuterung 3 in den Erläuterungen zum Abschluss für weitere Informationen.

(2) Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung des Wertpapierbestands.

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

Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC-Finanzderivate und -Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2023 und 31. Dezember 2022:

	Zum 30. Jun. 2023			Zum 31. Dez. 2022		
Kontrahent	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-engagement[1]	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-engagement[1]
BOA	$ (87)	$ 0	$ (87)	$ 1	$ 0	$ 1
BRC	(273)	243	(30)	k. A.	k. A.	k. A.
CBK	(9)	0	(9)	k. A.	k. A.	k. A.
GLM	7	(10)	(3)	2	0	2
GST	1	0	1	k. A.	k. A.	k. A.
MBC	144	0	144	k. A.	k. A.	k. A.
MYC	(33)	0	(33)	k. A.	k. A.	k. A.
MYI	(267)	0	(267)	k. A.	k. A.	k. A.
SCX	310	0	310	(57)	0	(57)
UAG	(88)	230	142	k. A.	k. A.	k. A.

(1) Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären.

Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung des Wertpapierbestands zum 30. Juni 2023:

	30. Jun. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	51,93	61,68
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	24,44	39,58
Investmentfonds	8,73	k. A.
Pensionsgeschäfte	12,76	k. A.
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	(0,03)	0,31
Zentral abgerechnete Finanzderivate	0,01	0,10
Freiverkehrsfinanzderivate	(0,51)	(0,54)

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 30. Juni 2023 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	30. Jun. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
Argentinien	0,50	0,58
Australien	0,30	k. A.

Anlagen zum Marktwert	30. Jun. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
Bermuda	0,36	k. A.
Brasilien	0,43	3,50
Kanada	1,21	0,72
Cayman-Inseln	0,52	1,75
Chile	0,39	1,46
Kolumbien	0,87	1,39
Costa Rica	0,37	k. A.
Dänemark	0,55	1,07
Dominikanische Republik	1,05	1,68
Ecuador	0,24	0,47
Ägypten	0,42	k. A.
Finnland	0,36	1,03
Frankreich	2,40	6,29
Deutschland	1,01	3,73
Guernsey, Kanalinseln	k. A.	0,95
Hongkong	0,35	k. A.
Ungarn	0,62	k. A.
Indien	0,44	1,95
Indonesien	0,86	k. A.
Irland	0,75	1,24
Italien	0,71	0,88
Elfenbeinküste	0,15	0,77
Japan	1,74	1,71
Kasachstan	0,37	k. A.
Liberia	0,56	k. A.
Jersey, Kanalinseln	k. A.	0,91
Luxemburg	0,55	1,95
Mexiko	1,09	0,86
Marokko	0,27	1,40
Mehrere Länder	k. A.	1,01
Multinational	1,17	0,49
Niederlande	3,34	2,45
Oman	0,51	1,91
Panama	1,45	1,06
Paraguay	0,44	k. A.
Peru	0,82	0,74
Philippinen	0,44	k. A.
Polen	0,21	k. A.
Rumänien	0,67	0,76
Serbien	0,25	k. A.
Singapur	0,08	0,96
Südafrika	0,53	k. A.
Spanien	1,99	3,85
Schweden	0,40	0,75
Großbritannien	4,29	7,18
USA	39,65	27,59
Uruguay	0,69	k. A.
Kurzfristige Instrumente	k. A.	16,22
Investmentfonds	8,73	k. A.
Pensionsgeschäfte	12,76	k. A.
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	(0,03)	0,31
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen - Schutzverkauf	0,00	k. A.
Zinsswaps	0,01	0,10
Freiverkehrsfinanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen - Schutzverkauf	(0,12)	k. A.
Devisenterminkontrakte	(1,90)	(0,61)
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	1,51	0,07
Sonstige Aktiva und Passiva	2,67	(1,13)
Nettovermögen	100,00	100,00

Aufstellung des Wertpapierbestands des Dynamic Bond Fund

BESCHREIBUNG		PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE				
KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG				
American Airlines, Inc.				
10,000 % fällig am 20.04.2028	$	900	$ 921	0,03
BCP Modular Services Holdings Ltd.				
8,023 % fällig am 15.12.2028	€	4.900	5.032	0,15
Carnival Corp.				
8,217 % fällig am 30.06.2025	$	2.619	2.618	0,08
Charter Communications Operating LLC				
6,795 % - 6,834 % fällig am 01.02.2027		187	186	0,01
Delos Finance SARL				
7,288 % fällig am 06.10.2023		3.220	3.222	0,10
Hertz Corp.				
8,443 % fällig am 30.06.2028		2.800	2.799	0,08
Hilton Domestic Operating Co., Inc.				
6,939 % fällig am 22.06.2026		4.774	4.775	0,14
Intelsat Jackson Holdings S.A.				
9,443 % fällig am 01.02.2029		347	346	0,01
IRB Holding Corp.				
8,202 % fällig am 15.12.2027		1.808	1.798	0,05
Acquisition Holdings LLC				
9,726 % fällig am 01.09.2028		4.421	3.963	0,12
Nouryon Finance BV				
6,478 % fällig am 03.04.2028	€	5.476	5.878	0,17
RegionalCare Hospital Partners Holdings, Inc.				
9,023 % fällig am 16.11.2025	$	4.479	4.160	0,12
United Airlines, Inc.				
9,292 % fällig am 21.04.2028		1.170	1.171	0,04
			36.869	1,10
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
BANKEN UND FINANZEN				
ABN AMRO Bank NV				
4,375 % fällig am 22.09.2025 (g)(i)	€	700	690	0,02
Acef Holding S.C.A.				
1,250 % fällig am 26.04.2030		2.000	1.672	0,05
Adler Financing SARL				
12,500 % fällig am 30.06.2025		2.989	3.347	0,10
AerCap Ireland Capital DAC				
2,450 % fällig am 29.10.2026	$	500	447	0,01
3,000 % fällig am 29.10.2028		200	173	0,01
3,650 % fällig am 21.07.2027		1.350	1.238	0,04
4,450 % fällig am 01.10.2025		2.850	2.743	0,08
4,450 % fällig am 03.04.2026		2.300	2.198	0,07
AGFC Capital Trust				
7,010 % fällig am 15.01.2067		2.500	1.348	0,04
AGPS BondCo PLC				
5,000 % fällig am 27.04.2027 ^	€	4.300	1.664	0,05
Aircastle Ltd.				
2,850 % fällig am 26.01.2028	$	1.500	1.277	0,04
Altarea S.C.A.				
1,750 % fällig am 16.01.2030	€	1.800	1.373	0,04
1,875 % fällig am 17.01.2028		1.700	1.500	0,04
AMCO - Asset Management Co. SpA				
1,500 % fällig am 17.07.2023		699	762	0,02
2,250 % fällig am 17.07.2027		2.600	2.577	0,08
American Tower Corp.				
0,400 % fällig am 15.02.2027		3.100	2.935	0,09
2,300 % fällig am 15.09.2031	$	300	239	0,01
Annington Funding PLC				
2,308 % fällig am 06.10.2032	£	1.000	885	0,03
Antares Holdings LP				
3,950 % fällig am 15.07.2026	$	1.600	1.406	0,04
Aroundtown S.A.				
0,375 % fällig am 15.04.2027	€	1.100	864	0,03
5,375 % fällig am 21.03.2029	$	16.200	12.004	0,36
Atrium Finance PLC				
2,625 % fällig am 05.09.2027	€	5.200	4.136	0,12
Aviation Capital Group LLC				
3,500 % fällig am 01.11.2027	$	3.600	3.183	0,09
5,500 % fällig am 15.12.2024		200	196	0,01
Avolon Holdings Funding Ltd.				
2,528 % fällig am 18.11.2027		4.290	3.622	0,11
Balder Finland Oyj				
1,000 % fällig am 18.01.2027	€	1.800	$ 1.481	0,04
Banca Monte dei Paschi di Siena SpA				
6,750 % fällig am 02.03.2026		6.500	7.108	0,21
Banco Santander S.A.				
4,375 % fällig am 14.01.2026 (g)(i)		3.200	2.934	0,09
5,147 % fällig am 18.08.2025	$	4.400	4.324	0,13
Bank of America Corp.				
2,687 % fällig am 22.04.2032		200	166	0,00
3,864 % fällig am 23.07.2024		5.300	5.294	0,16
4,300 % fällig am 28.01.2025 (g)		3.600	3.222	0,10
Bank of Ireland Group PLC				
7,500 % fällig am 19.05.2025 (g)(i)	€	3.700	3.967	0,12
Barclays PLC				
2,645 % fällig am 24.06.2031	$	900	723	0,02
3,330 % fällig am 24.11.2042		3.600	2.531	0,07
3,375 % fällig am 02.04.2025	€	1.100	1.186	0,03
4,337 % fällig am 10.01.2028	$	300	283	0,01
4,972 % fällig am 16.05.2029		300	284	0,01
5,304 % fällig am 09.08.2026		2.500	2.440	0,07
5,501 % fällig am 09.08.2028		600	586	0,02
6,375 % fällig am 15.12.2025 (g)(i)	£	1.700	1.871	0,06
7,125 % fällig am 15.06.2025 (g)(i)		900	1.041	0,03
7,385 % fällig am 02.11.2028	$	2.500	2.606	0,08
7,437 % fällig am 02.11.2033		2.700	2.923	0,09
7,750 % fällig am 15.09.2023 (g)(i)		800	786	0,02
8,000 % fällig am 15.06.2024 (g)(i)		400	379	0,01
Bevco Lux SARL				
1,000 % fällig am 16.01.2030	€	4.400	3.745	0,11
BGC Partners, Inc.				
4,375 % fällig am 15.12.2025	$	1.100	1.016	0,03
Blue Owl Finance LLC				
3,125 % fällig am 10.06.2031		4.500	3.429	0,10
BNP Paribas S.A.				
1,904 % fällig am 30.09.2028		7.800	6.652	0,20
2,000 % fällig am 13.09.2036	£	2.100	1.676	0,05
2,125 % fällig am 23.01.2027	€	2.400	2.455	0,07
4,400 % fällig am 14.08.2028	$	4.800	4.536	0,13
BPCE S.A.				
2,125 % fällig am 13.10.2046 (i)	€	3.800	2.970	0,09
Brown & Brown, Inc.				
4,200 % fällig am 15.09.2024	$	7.500	7.327	0,22
CaixaBank S.A.				
6,750 % fällig am 13.06.2024 (g)(i)	€	1.000	1.059	0,03
CapitaLand Ascendas REIT				
0,750 % fällig am 23.06.2028		3.200	2.794	0,08
CBRE Global Investors Open-Ended Fund S.C.A. SICAV-SIF Pan European Core Fund				
0,500 % fällig am 27.01.2028		2.000	1.726	0,05
0,900 % fällig am 12.10.2029		2.300	1.837	0,05
Cooperatieve Rabobank UA				
4,375 % fällig am 29.06.2027 (g)(i)		1.800	1.719	0,05
Coventry Building Society				
2,625 % fällig am 07.12.2026		1.100	1.153	0,03
CPI Property Group S.A.				
1,500 % fällig am 27.01.2031		5.400	3.212	0,10
1,625 % fällig am 23.04.2027		6.650	5.303	0,16
1,750 % fällig am 14.01.2030		100	66	0,00
2,750 % fällig am 12.05.2026		1.100	977	0,03
2,750 % fällig am 22.01.2028	£	5.950	5.067	0,15
4,875 % fällig am 16.07.2025 (g)	€	2.200	869	0,03
Credit Suisse AG				
0,250 % fällig am 01.09.2028		3.700	3.244	0,10
0,495 % fällig am 02.02.2024	$	1.800	1.732	0,05
6,500 % fällig am 08.08.2023 (i)		6.000	5.978	0,18
7,500 % fällig am 15.02.2028		300	319	0,01
Credit Suisse AG AT1 Claim ^		10.500	420	0,01
Cromwell Ereit Lux Finco SARL				
2,125 % fällig am 19.11.2025	€	3.100	2.919	0,09
Crown Castle, Inc.				
3,100 % fällig am 15.11.2029	$	250	218	0,01
3,800 % fällig am 15.02.2028		2.250	2.099	0,06
CTP NV				
0,625 % fällig am 27.09.2026	€	1.800	1.588	0,05
1,250 % fällig am 21.06.2029		5.100	4.042	0,12
1,500 % fällig am 27.09.2031		1.700	1.294	0,04
Deutsche Bank AG				
0,898 % fällig am 28.05.2024 (j)	$	1.900	$ 1.806	0,05
1,375 % fällig am 17.02.2032	€	4.600	3.724	0,11
1,625 % fällig am 20.01.2027		1.900	1.843	0,05
2,625 % fällig am 16.12.2024	£	1.200	1.420	0,04
3,035 % fällig am 28.05.2032 (j)	$	800	631	0,02
3,742 % fällig am 07.01.2033		1.200	881	0,03
3,875 % fällig am 12.02.2024	£	3.500	4.353	0,13
6,119 % fällig am 14.07.2026	$	8.902	8.806	0,26
Digital Dutch Finco BV				
1,500 % fällig am 15.03.2030	€	1.100	944	0,03
DVI Deutsche Vermögens- & Immobilienverwaltungs GmbH				
2,500 % fällig am 25.01.2027		3.500	2.901	0,09
EQT AB				
2,375 % fällig am 06.04.2028		1.200	1.155	0,03
Equinix, Inc.				
0,250 % fällig am 15.03.2027		1.500	1.427	0,04
3,900 % fällig am 15.04.2032	$	300	270	0,01
Erste Group Bank AG				
6,500 % fällig am 15.04.2024 (g)(i)	€	200	212	0,01
Fairfax Financial Holdings Ltd.				
4,625 % fällig am 29.04.2030	$	2.500	2.345	0,07
Ford Motor Credit Co. LLC				
2,330 % fällig am 25.11.2025	€	200	205	0,01
2,700 % fällig am 10.08.2026	$	3.900	3.486	0,10
2,748 % fällig am 14.06.2024	£	2.300	2.799	0,08
2,900 % fällig am 16.02.2028	$	1.800	1.543	0,05
3,021 % fällig am 06.03.2024	€	900	971	0,03
3,250 % fällig am 15.09.2025		100	105	0,00
4,535 % fällig am 06.03.2025	£	200	242	0,01
G City Europe Ltd.				
4,250 % fällig am 11.09.2025	€	1.200	1.145	0,03
Globalworth Real Estate Investments Ltd.				
2,950 % fällig am 29.07.2026		1.300	1.069	0,03
3,000 % fällig am 29.03.2025		3.100	2.799	0,08
Goldman Sachs Group, Inc.				
1,000 % fällig am 16.12.2025	£	2.500	2.933	0,09
1,875 % fällig am 16.12.2030		2.500	2.360	0,07
2,615 % fällig am 22.04.2032	$	200	164	0,00
3,615 % fällig am 15.03.2028		2.000	1.878	0,06
3,691 % fällig am 05.06.2028		300	282	0,01
3,750 % fällig am 22.05.2025		400	386	0,01
6,491 % fällig am 15.05.2026		800	810	0,02
HSBC Holdings PLC				
1,750 % fällig am 24.07.2027	£	3.200	3.469	0,10
2,357 % fällig am 18.08.2031	$	2.200	1.757	0,05
2,804 % fällig am 24.05.2032		800	647	0,02
2,871 % fällig am 22.11.2032		5.000	4.035	0,12
3,973 % fällig am 22.05.2030		4.700	4.225	0,13
4,583 % fällig am 19.06.2029		4.170	3.928	0,12
4,750 % fällig am 04.07.2029 (g)(i)	€	2.200	2.032	0,06
5,210 % fällig am 11.08.2028	$	2.600	2.544	0,08
6,254 % fällig am 09.03.2034		3.800	3.897	0,12
6,375 % fällig am 30.03.2025 (g)(i)		500	480	0,01
Huarong Finance Co. Ltd.				
3,375 % fällig am 24.02.2030		900	683	0,02
3,625 % fällig am 30.09.2030		2.600	1.975	0,06
3,875 % fällig am 13.11.2029		2.300	1.776	0,05
4,250 % fällig am 07.11.2027		500	417	0,01
4,500 % fällig am 29.05.2029		1.700	1.364	0,04
4,750 % fällig am 27.04.2027		1.300	1.126	0,03
4,950 % fällig am 07.11.2047		1.200	800	0,02
Hyundai Capital Services, Inc.				
0,750 % fällig am 15.09.2023		3.500	3.463	0,10
ING Groep NV				
5,750 % fällig am 16.11.2026 (g)(i)		900	796	0,02
Intesa Sanpaolo SpA				
0,750 % fällig am 16.03.2028	€	3.100	2.886	0,09
3,250 % fällig am 23.09.2024	$	5.800	5.566	0,16
4,000 % fällig am 23.09.2029		400	348	0,01
5,148 % fällig am 10.06.2030	£	1.400	1.440	0,04
JAB Holdings BV				
2,200 % fällig am 23.11.2030	$	4.900	3.857	0,11
JPMorgan Chase & Co.				
2,595 % fällig am 24.02.2026		6.400	6.072	0,18
3,220 % fällig am 01.03.2025		3.050	2.990	0,09
4,005 % fällig am 23.04.2029		4.500	4.241	0,13

BESCHREIBUNG		PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
Kennedy-Wilson, Inc.				
4,750 % fällig am 01.02.2030	$	3.000	$ 2.265	0,07
Lazard Group LLC				
4,375 % fällig am 11.03.2029		15.300	14.217	0,42
Legal & General Group PLC				
5,625 % fällig am 24.03.2031 (g)(i)	£	800	787	0,02
LFS Topco LLC				
5,875 % fällig am 15.10.2026	$	1.500	1.319	0,04
Lloyds Banking Group PLC				
4,375 % fällig am 22.03.2028		900	854	0,03
4,947 % fällig am 27.06.2025 (g)(i)	€	1.100	1.097	0,03
4,976 % fällig am 11.08.2033	$	2.900	2.714	0,08
Logicor Financing SARL				
0,625 % fällig am 17.11.2025	€	300	287	0,01
1,500 % fällig am 13.07.2026		2.300	2.169	0,06
1,625 % fällig am 17.01.2030		900	728	0,02
2,000 % fällig am 17.01.2034		1.000	726	0,02
2,750 % fällig am 15.01.2030	£	900	842	0,02
Mitsubishi HC Capital, Inc.				
3,960 % fällig am 19.09.2023	$	600	597	0,02
Mizuho Financial Group, Inc.				
0,470 % fällig am 06.09.2029	€	3.000	2.684	0,08
2,564 % fällig am 13.09.2031	$	1.600	1.260	0,04
Morgan Stanley				
0,000 % fällig am 02.04.2032 (j)		3.600	2.250	0,07
Morgan Stanley Domestic Holdings, Inc.				
4,500 % fällig am 20.06.2028		7.500	7.232	0,21
Mutuelle Assurance Des Commercants et Industriels de France et Des Cadres et Sal				
0,625 % fällig am 21.06.2027	€	1.200	1.119	0,03
2,125 % fällig am 21.06.2052		3.400	2.564	0,08
National Bank of Canada				
3,500 % fällig am 25.04.2028		1.800	1.954	0,06
Nationwide Building Society				
3,960 % fällig am 18.07.2030	$	900	800	0,02
4,302 % fällig am 08.03.2029		6.800	6.306	0,19
4,363 % fällig am 01.08.2024		2.000	1.996	0,06
5,875 % fällig am 20.12.2024 (g)(i)	£	1.600	1.902	0,06
NatWest Group PLC				
2,000 % fällig am 04.03.2025	€	4.500	4.820	0,14
4,892 % fällig am 18.05.2029	$	1.700	1.619	0,05
5,125 % fällig am 12.05.2027 (g)(i)	£	200	210	0,01
NatWest Markets PLC				
1,000 % fällig am 28.05.2024	€	1.700	1.803	0,05
Nissan Motor Acceptance Co. LLC				
1,850 % fällig am 16.09.2026	$	1.600	1.358	0,04
2,000 % fällig am 09.03.2026		1.400	1.226	0,04
2,450 % fällig am 15.09.2028		700	559	0,02
Nova Ljubljanska Banka d.d.				
3,400 % fällig am 05.02.2030	€	2.500	2.318	0,07
3,650 % fällig am 19.11.2029		2.900	2.689	0,08
Nuveen Finance LLC				
4,125 % fällig am 01.11.2024	$	500	486	0,01
Ohio National Financial Services, Inc.				
6,800 % fällig am 24.01.2030		3.500	3.258	0,10
OneMain Finance Corp.				
6,125 % fällig am 15.03.2024		2.650	2.643	0,08
Owl Rock Capital Corp.				
2,875 % fällig am 11.06.2028		1.900	1.550	0,05
Park Aerospace Holdings Ltd.				
5,500 % fällig am 15.02.2024		28	28	0,00
Piper Sandler Cos.				
5,200 % fällig am 15.10.2023		3.600	3.591	0,11
PRA Group, Inc.				
7,375 % fällig am 01.09.2025		1.100	1.047	0,03
Prologis International Funding S.A.				
3,125 % fällig am 01.06.2031	€	2.200	2.128	0,06
RLJ Lodging Trust LP				
3,750 % fällig am 01.07.2026	$	1.600	1.469	0,04
Sagax AB				
1,125 % fällig am 30.01.2027	€	3.800	3.499	0,10
2,000 % fällig am 17.01.2024		190	203	0,01
2,250 % fällig am 13.03.2025		2.200	2.268	0,07
Sagax Euro MTN NL BV				
0,750 % fällig am 26.01.2028		2.200	1.821	0,05
1,000 % fällig am 17.05.2029		1.200	934	0,03
Samhallsbyggnadsbolaget i Norden AB				
1,000 % fällig am 12.08.2027 (k)	€	1.400	$ 994	0,03
Santander UK Group Holdings PLC				
3,823 % fällig am 03.11.2028	$	3.100	2.793	0,08
4,796 % fällig am 15.11.2024		8.800	8.734	0,26
6,750 % fällig am 24.06.2024 (g)(i)	£	400	477	0,01
SELP Finance SARL				
3,750 % fällig am 10.08.2027	€	3.300	3.375	0,10
Sirius Real Estate Ltd.				
1,125 % fällig am 22.06.2026		4.800	4.330	0,13
Societe Generale S.A.				
4,677 % fällig am 15.06.2027	$	3.700	3.568	0,11
Sofina S.A.				
1,000 % fällig am 23.09.2028	€	2.900	2.534	0,07
Spirit Realty LP				
4,000 % fällig am 15.07.2029	$	400	352	0,01
Stichting AK Rabobank Certificaten				
6,500 % (g)	€	1.996	2.025	0,06
STORE Capital Corp.				
4,625 % fällig am 15.03.2029	$	200	169	0,01
Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd.				
3,629 % fällig am 06.04.2026	€	3.300	3.556	0,11
Synchrony Financial				
4,500 % fällig am 23.07.2025	$	800	755	0,02
5,150 % fällig am 19.03.2029		9.000	8.178	0,24
Toronto-Dominion Bank				
3,879 % fällig am 13.03.2026	€	23.400	25.495	0,76
TP ICAP Finance PLC				
2,625 % fällig am 18.11.2028	£	1.200	1.128	0,03
5,250 % fällig am 29.05.2026		3.500	4.100	0,12
UBS Group AG				
2,125 % fällig am 12.09.2025		500	595	0,02
3,091 % fällig am 14.05.2032	$	950	769	0,02
3,750 % fällig am 26.03.2025		700	670	0,02
3,869 % fällig am 12.01.2029		4.750	4.298	0,13
4,194 % fällig am 01.04.2031		2.100	1.870	0,06
4,375 % fällig am 10.02.2031 (g)(i)		1.300	919	0,03
4,550 % fällig am 17.04.2026		1.200	1.154	0,03
4,703 % fällig am 05.08.2027		1.400	1.339	0,04
6,442 % fällig am 11.08.2028		4.750	4.772	0,14
7,750 % fällig am 01.03.2029	€	400	484	0,01
UniCredit SpA				
2,569 % fällig am 22.09.2026	$	350	316	0,01
7,830 % fällig am 04.12.2023		12.000	12.072	0,36
Ursa Re Ltd.				
9,208 % fällig am 07.12.2027		6.000	5.976	0,18
VICI Properties LP				
3,500 % fällig am 15.02.2025		1.700	1.626	0,05
3,750 % fällig am 15.02.2027		3.300	3.030	0,09
4,125 % fällig am 15.08.2030		2.500	2.203	0,07
4,750 % fällig am 15.02.2028		2.300	2.180	0,06
Virgin Money UK PLC				
3,375 % fällig am 24.04.2026	£	200	232	0,01
Volkswagen Financial Services NV				
0,875 % fällig am 20.02.2025		3.200	3.705	0,11
2,750 % fällig am 10.07.2023		2.400	3.050	0,09
Wells Fargo & Co.				
3,000 % fällig am 22.04.2026	$	2.100	1.976	0,06
3,526 % fällig am 24.03.2028		2.600	2.429	0,07
Workspace Group PLC				
2,250 % fällig am 11.03.2028	£	2.700	2.517	0,07
WPC Eurobond BV				
1,350 % fällig am 15.04.2028	€	1.700	1.577	0,05
			537.282	15,96
INDUSTRIEWERTE				
AA Bond Co. Ltd.				
3,250 % fällig am 31.07.2050	£	2.300	2.228	0,07
Accor S.A.				
2,375 % fällig am 29.11.2028	€	3.500	3.437	0,10
Adani Ports & Special Economic Zone Ltd.				
3,100 % fällig am 02.02.2031	$	5.000	3.503	0,10
3,375 % fällig am 24.07.2024		3.287	3.142	0,09
Aeroporti di Roma SpA				
1,750 % fällig am 30.07.2031	€	3.800	3.367	0,10
Air Canada				
3,875 % fällig am 15.08.2026	$	1.300	1.206	0,04
Air Canada Pass-Through Trust				
3,600 % fällig am 15.09.2028	$	1.035	$ 962	0,03
Alaska Airlines Pass-Through Trust				
4,800 % fällig am 15.02.2029		884	851	0,03
Allegiant Travel Co.				
7,250 % fällig am 15.08.2027		2.600	2.593	0,08
Altice France S.A.				
4,250 % fällig am 15.10.2029	€	2.300	1.812	0,05
5,500 % fällig am 15.10.2029	$	2.500	1.790	0,05
AMC Networks, Inc.				
4,750 % fällig am 01.08.2025		1.700	1.489	0,04
American Airlines Pass-Through Trust				
3,000 % fällig am 15.04.2030		418	372	0,01
3,250 % fällig am 15.04.2030		139	118	0,00
3,350 % fällig am 15.04.2031		802	714	0,02
3,375 % fällig am 01.11.2028		961	863	0,03
3,575 % fällig am 15.07.2029		967	897	0,03
3,700 % fällig am 01.04.2028		166	149	0,00
American Airlines, Inc.				
5,500 % fällig am 20.04.2026		1.300	1.289	0,04
5,750 % fällig am 20.04.2029		3.900	3.790	0,11
Bayer U.S. Finance LLC				
3,875 % fällig am 15.12.2023		400	396	0,01
6,562 % fällig am 15.12.2023		200	200	0,01
Becton Dickinson Euro Finance SARL				
1,336 % fällig am 13.08.2041	€	3.100	2.165	0,06
Bellis Acquisition Co. PLC				
3,250 % fällig am 16.02.2026	£	7.600	8.110	0,24
Boeing Co.				
1,950 % fällig am 01.02.2024	$	700	684	0,02
2,750 % fällig am 01.02.2026		5.100	4.751	0,14
British Airways Pass-Through Trust				
2,900 % fällig am 15.09.2036		1.528	1.263	0,04
4,250 % fällig am 15.05.2034		674	616	0,02
Broadcom, Inc.				
3,137 % fällig am 15.11.2035		4	3	0,00
4,926 % fällig am 15.05.2037		4	4	0,00
Caesars Entertainment, Inc.				
6,250 % fällig am 01.07.2025		400	399	0,01
Carnival Holdings Bermuda Ltd.				
10,375 % fällig am 01.05.2028		2.500	2.737	0,08
CCO Holdings LLC				
5,000 % fällig am 01.02.2028		1.550	1.414	0,04
Charter Communications Operating LLC				
3,500 % fällig am 01.06.2041		2.000	1.354	0,04
3,900 % fällig am 01.06.2052		1.900	1.245	0,04
4,908 % fällig am 23.07.2025		2.970	2.913	0,09
6,384 % fällig am 23.10.2035		875	853	0,03
6,484 % fällig am 23.10.2045		1.100	1.035	0,03
6,834 % fällig am 23.10.2055		150	142	0,00
Cigna Group				
3,750 % fällig am 15.07.2023		794	793	0,02
Cloud Software Group, Inc.				
6,500 % fällig am 31.03.2029		3.800	3.387	0,10
Constellation Oil Services Holding S.A.				
13,500 % fällig am 30.06.2025		341	336	0,01
Constellation Oil Services Holding S.A. (3,000 % bar und 4,000 % PIK)				
3,000 % fällig am 31.12.2026 (c)		944	559	0,02
Coty, Inc.				
3,875 % fällig am 15.04.2026	€	4.200	4.453	0,13
4,750 % fällig am 15.01.2029	$	2.000	1.846	0,05
DAE Funding LLC				
1,625 % fällig am 15.02.2024		2.500	2.411	0,07
DISH DBS Corp.				
5,250 % fällig am 01.12.2026		1.000	804	0,02
5,750 % fällig am 01.12.2028		2.000	1.491	0,04
DISH Network Corp.				
11,750 % fällig am 15.11.2027		6.400	6.253	0,19
Exela Intermediate LLC				
11,500 % fällig am 15.07.2026		1.126	107	0,00
Expedia Group, Inc.				
2,950 % fällig am 15.03.2031		540	456	0,01
6,250 % fällig am 01.05.2025		2.069	2.077	0,06
Ford Motor Co.				
3,250 % fällig am 12.02.2032		1.300	1.024	0,03

BESCHREIBUNG		PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
Fraport AG Frankfurt Airport Services Worldwide				
2,125 % fällig am 09.07.2027	€	1.900	$ 1.904	0,06
Global Payments, Inc.				
5,300 % fällig am 15.08.2029	$	1.800	1.755	0,05
GN Store Nord A/S				
0,875 % fällig am 25.11.2024	€	3.400	3.461	0,10
Grifols Escrow Issuer S.A.				
3,875 % fällig am 15.10.2028		3.100	2.903	0,09
Haleon U.S. Capital LLC				
3,375 % fällig am 24.03.2029	$	1.850	1.682	0,05
Haleon UK Capital PLC				
3,125 % fällig am 24.03.2025		3.000	2.868	0,09
HCA, Inc.				
5,375 % fällig am 01.09.2026		900	893	0,03
Hilton Domestic Operating Co., Inc.				
3,750 % fällig am 01.05.2029		300	267	0,01
4,000 % fällig am 01.05.2031		3.200	2.782	0,08
Hilton Grand Vacations Borrower Escrow LLC				
5,000 % fällig am 01.06.2029		4.000	3.554	0,11
Holding d'Infrastructures des Metiers de l'Environnement				
0,125 % fällig am 16.09.2025	€	1.600	1.577	0,05
0,625 % fällig am 16.09.2028		2.200	1.965	0,06
IHO Verwaltungs GmbH (3,750 % bar oder 4,500 % PIK)				
3,750 % fällig am 15.09.2026 (c)		3.200	3.266	0,10
Imperial Brands Finance Netherlands BV				
1,750 % fällig am 18.03.2033		1.700	1.344	0,04
Intelsat Jackson Holdings S.A.				
6,500 % fällig am 15.03.2030	$	1.406	1.284	0,04
JetBlue Pass-Through Trust				
2,750 % fällig am 15.11.2033		168	144	0,00
Kraft Heinz Foods Co.				
5,000 % fällig am 15.07.2035		73	72	0,00
Las Vegas Sands Corp.				
3,900 % fällig am 08.08.2029		200	179	0,01
Lendlease Europe Finance PLC				
3,500 % fällig am 02.12.2033	£	899	748	0,02
Melco Resorts Finance Ltd.				
5,375 % fällig am 04.12.2029	$	200	166	0,00
Mileage Plus Holdings LLC				
6,500 % fällig am 20.06.2027		5.280	5.298	0,16
\cquisition Holdings LLC				
5,500 % fällig am 01.09.2028		3.300	2.817	0,08
Mundys SpA				
1,875 % fällig am 12.02.2028	€	10.100	9.422	0,28
Nidec Corp.				
0,046 % fällig am 30.03.2026		1.100	1.079	0,03
Nissan Motor Co. Ltd.				
3,522 % fällig am 17.09.2025	$	7.500	6.980	0,21
4,345 % fällig am 17.09.2027		1.700	1.547	0,05
4,810 % fällig am 17.09.2030		500	439	0,01
Penske Truck Leasing Co. LP				
3,950 % fällig am 10.03.2025		2.000	1.923	0,06
Petroleos Mexicanos				
6,700 % fällig am 16.02.2032		4.981	3.792	0,11
10,000 % fällig am 07.02.2033		900	825	0,02
Prosus NV				
3,680 % fällig am 21.01.2030		600	510	0,02
Sabine Pass Liquefaction LLC				
4,200 % fällig am 15.03.2028		4.000	3.793	0,11
5,000 % fällig am 15.03.2027		800	788	0,02
Sands China Ltd.				
3,350 % fällig am 08.03.2029		900	751	0,02
3,750 % fällig am 08.08.2031		1.100	896	0,03
5,900 % fällig am 08.08.2028		7.800	7.442	0,22
Scripps Escrow, Inc.				
5,375 % fällig am 15.01.2031		1.600	1.129	0,03
Southern Co.				
3,700 % fällig am 30.04.2030		400	367	0,01
Studio City Finance Ltd.				
5,000 % fällig am 15.01.2029		600	445	0,01
Syngenta Finance NV				
3,375 % fällig am 16.04.2026	€	1.000	1.048	0,03
T-Mobile USA, Inc.				
2,250 % fällig am 15.11.2031	$	2.300	1.841	0,05
3,300 % fällig am 15.02.2051		2.700	1.896	0,06
3,875 % fällig am 15.04.2030	$	4.200	3.872	0,12
TD SYNNEX Corp.				
2,375 % fällig am 09.08.2028		5.800	4.757	0,14
TDF Infrastructure SASU				
1,750 % fällig am 01.12.2029	€	6.400	5.633	0,17
Tesco Corporate Treasury Services PLC				
0,875 % fällig am 29.05.2026		2.200	$ 2.192	0,07
Toyota Tsusho Corp.				
3,625 % fällig am 13.09.2023	$	3.400	3.385	0,10
United Airlines Pass-Through Trust				
5,875 % fällig am 15.04.2029		3.090	3.068	0,09
United Airlines, Inc.				
4,625 % fällig am 15.04.2029		200	182	0,01
Venture Global Calcasieu Pass LLC				
3,875 % fällig am 01.11.2033		6.400	5.249	0,16
6,250 % fällig am 15.01.2030		4.800	4.766	0,14
Virgin Media Secured Finance PLC				
4,250 % fällig am 15.01.2030	£	4.000	4.014	0,12
Vmed O2 UK Financing PLC				
4,500 % fällig am 15.07.2031		2.800	2.710	0,08
Wabtec Transportation Netherlands BV				
1,250 % fällig am 03.12.2027	€	4.600	4.362	0,13
WMG Acquisition Corp.				
2,250 % fällig am 15.08.2031		2.300	1.998	0,06
Wynn Macau Ltd.				
5,500 % fällig am 15.01.2026	$	400	372	0,01
5,500 % fällig am 01.10.2027		200	178	0,01
			225.433	6,69
VERSORGUNGSUNTERNEHMEN				
AES Corp.				
2,450 % fällig am 15.01.2031		2.200	1.779	0,05
CK Hutchison Group Telecom Finance S.A.				
1,500 % fällig am 17.10.2031	€	2.500	2.164	0,06
2,625 % fällig am 17.10.2034	£	2.500	2.091	0,06
Entergy Corp.				
2,400 % fällig am 15.06.2031	$	300	243	0,01
Georgia Power Co.				
4,700 % fällig am 15.05.2032		1.200	1.161	0,04
NextEra Energy Capital Holdings, Inc.				
4,625 % fällig am 15.07.2027		350	342	0,01
ONEOK, Inc.				
4,350 % fällig am 15.03.2029		100	93	0,00
Pacific Gas & Electric Co.				
3,000 % fällig am 15.06.2028		2.400	2.071	0,06
3,150 % fällig am 01.01.2026		500	464	0,01
3,250 % fällig am 01.06.2031		2.400	1.954	0,06
3,300 % fällig am 01.12.2027 ^		3.000	2.633	0,08
3,500 % fällig am 15.06.2025 ^		200	189	0,01
3,500 % fällig am 01.08.2050		300	191	0,01
4,300 % fällig am 15.03.2045 ^		500	357	0,01
4,550 % fällig am 01.07.2030		4.100	3.714	0,11
4,950 % fällig am 08.06.2025		1.500	1.455	0,04
5,450 % fällig am 15.06.2027		200	195	0,01
6,150 % fällig am 15.01.2033		3.800	3.719	0,11
Southern California Gas Co.				
2,950 % fällig am 15.04.2027		1.900	1.774	0,05
Southern Co. Gas Capital Corp.				
2,450 % fällig am 01.10.2023		500	496	0,02
Sprint LLC				
7,125 % fällig am 15.06.2024		800	808	0,02
			27.893	0,83
ıe Unternehmensanleihen und Wechsel			790.608	23,48
WANDELANLEIHEN & WECHSEL				
Southwest Airlines Co.				
1,250 % fällig am 01.05.2025		7.500	8.627	0,26
KOMMUNALANLEIHEN UND WECHSEL				
California State General Obligation Bonds, (BABs), (AGM/CR Insured), Series 2010				
6,875 % fällig am 01.11.2026		2.345	2.481	0,07
Commonwealth of Puerto Rico General Obligation Bonds, Series 2022				
0,000 % fällig am 01.11.2043		40	20	0,00
Golden State, California Tobacco Securitization Corp. Revenue Notes, Series 2021				
1,711 % fällig am 01.06.2024	$	1.900	$ 1.832	0,05
Illinois State General Obligation Bonds, (BABs), Series 2010				
7,350 % fällig am 01.07.2035		696	751	0,02
Tobacco Settlement Finance Authority, West Virginia Revenue Bonds, Series 2007				
0,000 % fällig am 01.06.2047 (e)		23.300	2.203	0,07
Tobacco Settlement Finance Authority, West Virginia Revenue Bonds, Series 2020				
3,151 % fällig am 01.06.2032		1.500	1.247	0,04
3,301 % fällig am 01.06.2033		800	661	0,02
			9.195	0,27
US-REGIERUNGSBEHÖRDEN				
Fannie Mae				
0,000 % fällig am 25.09.2060 (a)		13.399	1.145	0,03
0,469 % fällig am 25.07.2042 (a)		20.080	267	0,01
0,612 % fällig am 25.06.2042 (a)		15.872	187	0,01
0,750 % fällig am 25.12.2056 (a)		3.596	466	0,01
0,900 % fällig am 25.07.2059 (a)		8.938	950	0,03
0,925 % fällig am 25.11.2046 (a)		5.676	117	0,00
0,950 % fällig am 25.07.2050 (a)		4.245	405	0,01
1,000 % fällig am 25.07.2043 (a)		1.093	117	0,00
1,050 % fällig am 25.05.2048 (a)		1.801	190	0,01
1,350 % fällig am 25.03.2042 (a)		7.029	690	0,02
1,450 % fällig am 25.11.2035 (a)		77	1	0,00
1,480 % fällig am 25.10.2039 (a)		1.234	20	0,00
2,000 % fällig am 25.11.2050 (a)		4.090	401	0,01
2,226 % fällig am 25.06.2043 (a)		5.088	341	0,01
3,795 % fällig am 01.12.2034		2	2	0,00
3,956 % fällig am 01.02.2035		3	3	0,00
4,000 % fällig am 25.06.2050 (a)		5.746	1.130	0,03
4,944 % fällig am 01.11.2042		11	10	0,00
5,249 % fällig am 25.02.2032		24	24	0,00
5,258 % fällig am 25.03.2034		28	28	0,00
5,268 % fällig am 25.11.2031		4	4	0,00
5,307 % fällig am 25.11.2032		7	7	0,00
5,500 % fällig am 25.03.2037		18	18	0,00
5,550 % fällig am 25.09.2032		2	2	0,00
5,596 % fällig am 18.10.2030		3	3	0,00
5,682 % fällig am 25.03.2036		256	271	0,01
Freddie Mac				
0,000 % fällig am 15.08.2042		1.053	733	0,02
0,737 % fällig am 15.12.2037 (a)		301	20	0,00
0,950 % fällig am 25.06.2050 (a)		9.212	920	0,03
0,957 % fällig am 15.07.2047 (a)		134	14	0,00
1,000 % fällig am 25.06.2050 (a)		12.368	1.414	0,04
1,417 % fällig am 15.04.2042 (a)		152	14	0,00
1,500 % fällig am 25.12.2035 (a)		8.373	370	0,01
2,000 % fällig am 25.12.2050 (a)		19.940	1.842	0,06
4,000 % fällig am 15.01.2033 - 25.07.2050 (a)		17.392	3.397	0,10
4,000 % fällig am 01.07.2047		110	105	0,00
4,575 % fällig am 01.09.2027		1	1	0,00
5,290 % fällig am 25.09.2031		84	84	0,00
5,376 % fällig am 25.07.2044		332	309	0,01
5,500 % fällig am 01.04.2027 - 01.01.2040		448	455	0,01
Ginnie Mae				
2,625 % fällig am 20.09.2031		104	101	0,00
2,750 % fällig am 20.11.2029		2	2	0,00
3,500 % fällig am 15.07.2045		10.809	10.107	0,30
4,000 % fällig am 20.10.2042 (a)		3.626	612	0,02
4,000 % fällig am 15.02.2052		4.435	4.239	0,13
4,500 % fällig am 20.10.2045 (a)		2.405	473	0,01
Ginnie Mae, TBA				
4,000 % fällig am 01.07.2053		3.000	2.860	0,09
Uniform Mortgage-Backed Security				
3,500 % fällig am 01.04.2037 - 01.07.2048		12.259	11.333	0,34
4,000 % fällig am 01.05.2047 - 01.03.2049		9.303	8.893	0,26
4,500 % fällig am 01.04.2028		5	5	0,00
5,500 % fällig am 01.07.2026 - 01.08.2040		463	466	0,01
6,000 % fällig am 01.10.2025 - 01.05.2041		248	253	0,01

BESCHREIBUNG		PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
Uniform Mortgage-Backed Security, TBA				
2,500 % fällig am 01.08.2053	$	30.200	$ 25.651	0,76
3,000 % fällig am 01.08.2053		50.300	44.341	1,32
3,500 % fällig am 01.08.2053		119.800	109.294	3,25
4,000 % fällig am 01.08.2053		160.200	150.482	4,47
4,500 % fällig am 01.07.2053		120.300	115.689	3,44
5,000 % fällig am 01.08.2053		192.600	188.763	5,60
			690.041	20,48
US-SCHATZOBLIGATIONEN				
U.S. Treasury Notes				
0,250 % fällig am 31.08.2025		12.200	11.072	0,33
1,250 % fällig am 31.08.2024		84.500	80.613	2,39
			91.685	2,72
NON-AGENCY-MBS				
Adjustable Rate Mortgage Trust				
3,839 % fällig am 25.11.2035 ^		253	192	0,01
4,184 % fällig am 25.02.2036 ^		1.285	906	0,03
4,394 % fällig am 25.03.2037 ^		8	7	0,00
4,521 % fällig am 25.01.2036 ^		30	28	0,00
4,601 % fällig am 25.10.2035 ^		117	111	0,00
4,803 % fällig am 25.08.2035		24	22	0,00
5,670 % fällig am 25.01.2036		1.006	940	0,03
Alba PLC				
5,191 % fällig am 17.03.2039	£	970	1.186	0,04
American Home Mortgage Assets Trust				
4,896 % fällig am 25.11.2046	$	59	18	0,00
5,570 % fällig am 25.06.2037		3.019	2.815	0,08
6,750 % fällig am 25.11.2046		743	644	0,02
American Home Mortgage Investment Trust				
7,369 % fällig am 25.11.2045 ^		229	107	0,00
Atlas Funding PLC				
5,937 % fällig am 20.01.2061	£	1.238	1.575	0,05
Banc of America Alternative Loan Trust				
1,490 % fällig am 25.06.2037 ^(a)	$	648	52	0,00
5,510 % fällig am 25.06.2037		597	444	0,01
6,000 % fällig am 25.06.2046 ^		250	220	0,01
6,000 % fällig am 25.07.2046 ^		509	429	0,01
Banc of America Funding Trust				
2,913 % fällig am 20.10.2046 ^		71	57	0,00
3,423 % fällig am 20.12.2034 ^		11	9	0,00
3,790 % fällig am 20.06.2037 ^		61	51	0,00
3,858 % fällig am 20.11.2034		368	334	0,01
3,969 % fällig am 20.05.2036 ^		153	133	0,00
4,106 % fällig am 20.04.2035 ^		789	689	0,02
4,416 % fällig am 20.01.2047 ^		367	340	0,01
4,449 % fällig am 20.02.2036		96	91	0,00
4,934 % fällig am 20.06.2036 ^		11	10	0,00
5,210 % fällig am 25.01.2037 ^		99	86	0,00
5,477 % fällig am 20.02.2047		636	656	0,02
5,537 % fällig am 20.07.2036		3.587	3.489	0,10
5,537 % fällig am 20.12.2046 ^		200	165	0,01
5,950 % fällig am 25.05.2037 ^		601	516	0,02
Banc of America Mortgage Trust				
3,893 % fällig am 25.02.2035		66	62	0,00
4,153 % fällig am 25.01.2035		26	24	0,00
4,354 % fällig am 25.05.2035 ^		226	201	0,01
4,596 % fällig am 25.06.2035		46	39	0,00
5,750 % fällig am 20.07.2032		0	0	0,00
BCAP LLC Trust				
3,333 % fällig am 26.11.2036		1.362	1.317	0,04
4,590 % fällig am 26.03.2037		1.176	1.690	0,05
5,250 % fällig am 26.02.2036		560	250	0,01
5,250 % fällig am 26.06.2036		12.620	5.313	0,16
5,250 % fällig am 26.04.2037		620	361	0,01
5,250 % fällig am 26.06.2037		129	115	0,00
5,490 % fällig am 25.01.2037 ^		1.925	1.773	0,05
5,510 % fällig am 25.03.2037		725	649	0,02
6,450 % fällig am 25.09.2047		888	778	0,02
Bear Stearns Adjustable Rate Mortgage Trust				
3,250 % fällig am 25.02.2033		1	0	0,00
3,553 % fällig am 25.09.2034		302	279	0,01
3,887 % fällig am 25.05.2047 ^		568	509	0,02
4,033 % fällig am 25.11.2034		41	37	0,00
4,065 % fällig am 25.04.2033		6	6	0,00
4,146 % fällig am 25.08.2035 ^		48	43	0,00
4,201 % fällig am 25.01.2034		37	36	0,00
4,216 % fällig am 25.01.2035		273	261	0,01
4,336 % fällig am 25.01.2035	$	35	$ 31	0,00
4,374 % fällig am 25.08.2033		98	94	0,00
4,513 % fällig am 25.04.2033		3	3	0,00
4,517 % fällig am 25.01.2035		22	21	0,00
4,670 % fällig am 25.11.2034		38	32	0,00
4,752 % fällig am 25.07.2034		43	40	0,00
Bear Stearns ALT-A Trust				
3,250 % fällig am 25.02.2034		8	7	0,00
3,634 % fällig am 25.09.2035 ^		3.846	1.654	0,05
3,651 % fällig am 25.04.2035		46	39	0,00
3,731 % fällig am 25.11.2036 ^		1.198	568	0,02
3,781 % fällig am 25.11.2036		3.175	1.803	0,05
3,920 % fällig am 25.09.2034		95	88	0,00
3,971 % fällig am 25.05.2036 ^		489	247	0,01
3,989 % fällig am 25.03.2036 ^		224	171	0,01
4,195 % fällig am 25.05.2035		304	287	0,01
4,812 % fällig am 25.01.2034		43	38	0,00
5,470 % fällig am 25.02.2034		136	121	0,00
5,490 % fällig am 25.08.2036 ^		179	170	0,01
5,550 % fällig am 25.02.2034		672	600	0,02
5,590 % fällig am 25.04.2036 ^		415	352	0,01
5,630 % fällig am 25.02.2036		299	261	0,01
Bear Stearns Mortgage Funding Trust				
5,330 % fällig am 25.06.2037		611	552	0,02
Bear Stearns Structured Products, Inc. Trust				
3,484 % fällig am 26.12.2046 ^		456	344	0,01
Canada Square Funding PLC				
5,316 % fällig am 17.01.2059	£	2.291	2.896	0,09
Canterbury Finance PLC				
5,377 % fällig am 16.05.2058		392	498	0,02
Charter Mortgage Funding PLC				
5,327 % fällig am 16.01.2057		1.429	1.815	0,05
Chase Mortgage Finance Trust				
3,848 % fällig am 25.03.2037 ^	$	326	297	0,01
4,086 % fällig am 25.03.2037 ^		26	25	0,00
4,483 % fällig am 25.02.2037		15	15	0,00
ChaseFlex Trust				
5,750 % fällig am 25.07.2037		11	9	0,00
ChaseFlex Trust Multi-Class Mortgage Pass-Through Certificates Trust				
4,176 % fällig am 25.08.2037 ^		552	471	0,01
4,176 % fällig am 25.08.2037 ^		247	205	0,01
Chevy Chase Funding LLC Mortgage-Backed Certificates				
5,330 % fällig am 25.05.2036		27	24	0,00
Citicorp Mortgage Securities Trust				
6,000 % fällig am 25.09.2037		34	32	0,00
Citigroup Global Markets Mortgage Securities, Inc.				
5,650 % fällig am 25.05.2032		27	27	0,00
Citigroup Mortgage Loan Trust				
3,620 % fällig am 25.10.2046 ^		306	272	0,01
4,288 % fällig am 25.07.2037 ^		8	7	0,00
4,321 % fällig am 25.03.2034		68	64	0,00
4,418 % fällig am 25.08.2035		42	41	0,00
5,351 % fällig am 25.09.2037 ^		82	72	0,00
6,470 % fällig am 25.11.2035		68	67	0,00
6,980 % fällig am 25.05.2035		43	42	0,00
Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.				
4,183 % fällig am 25.02.2034		12	11	0,00
6,430 % fällig am 25.09.2035		1	1	0,00
CitiMortgage Alternative Loan Trust				
5,750 % fällig am 25.01.2037		1.114	920	0,03
5,750 % fällig am 25.06.2037		1.603	1.312	0,04
5,800 % fällig am 25.09.2036		1.494	1.228	0,04
6,000 % fällig am 25.10.2037 ^		684	600	0,02
Countrywide Alternative Loan Resecuritization Trust				
6,000 % fällig am 25.05.2036 ^		98	59	0,00
Countrywide Alternative Loan Trust				
0,000 % fällig am 25.12.2035 (a)		1.075	66	0,00
4,976 % fällig am 25.12.2035		2.209	1.861	0,06
5,000 % fällig am 25.03.2035		5	4	0,00
5,337 % fällig am 20.02.2047 ^		319	249	0,01
5,347 % fällig am 20.03.2047		5.058	4.166	0,12
5,350 % fällig am 25.04.2047		224	211	0,01
5,352 % fällig am 20.12.2046 ^		11.118	9.317	0,28
5,430 % fällig am 25.06.2037		681	613	0,02
5,430 % fällig am 25.04.2047		1.212	1.080	0,03
5,437 % fällig am 20.09.2046		578	416	0,01
5,470 % fällig am 25.09.2047		575	499	0,02
5,490 % fällig am 25.05.2047		563	485	0,01
5,500 % fällig am 25.04.2035	$	120	$ 85	0,00
5,500 % fällig am 25.09.2035 ^		241	148	0,00
5,500 % fällig am 25.11.2035 ^		171	103	0,00
5,500 % fällig am 25.12.2035 ^		106	47	0,00
5,500 % fällig am 25.12.2035 ^		3.167	2.074	0,06
5,500 % fällig am 25.12.2035		1.077	483	0,01
5,500 % fällig am 25.01.2036		21	13	0,00
5,500 % fällig am 25.05.2036 ^		418	327	0,01
5,510 % fällig am 25.05.2047		800	689	0,02
5,520 % fällig am 25.02.2037 ^		1.963	600	0,02
5,530 % fällig am 25.07.2046 ^		296	286	0,01
5,530 % fällig am 25.09.2046 ^		17	16	0,00
5,577 % fällig am 20.03.2046		51	42	0,00
5,577 % fällig am 20.05.2046 ^		300	255	0,01
5,630 % fällig am 25.01.2037		2.202	1.794	0,05
5,710 % fällig am 25.02.2037		753	623	0,02
5,730 % fällig am 25.02.2036 ^		1.683	1.490	0,04
5,750 % fällig am 25.02.2035		140	100	0,00
5,750 % fällig am 25.07.2035 ^		675	435	0,01
5,750 % fällig am 25.05.2036		434	186	0,01
5,750 % fällig am 25.03.2037 ^		389	221	0,01
5,803 % fällig am 20.11.2035		21	18	0,00
5,860 % fällig am 25.07.2036 ^		552	209	0,01
6,000 % fällig am 25.10.2035 ^		1.316	917	0,03
6,000 % fällig am 25.04.2036		594	308	0,01
6,000 % fällig am 25.04.2036 ^		120	62	0,00
6,000 % fällig am 25.04.2036 ^		95	51	0,00
6,000 % fällig am 25.08.2036 ^		122	76	0,00
6,000 % fällig am 25.12.2036 ^		1.243	545	0,02
6,000 % fällig am 25.02.2037 ^		227	104	0,00
6,000 % fällig am 25.03.2037 ^		287	115	0,00
6,000 % fällig am 25.04.2037 ^		559	277	0,01
6,000 % fällig am 25.05.2037 ^		94	48	0,00
6,000 % fällig am 25.08.2037 ^		645	335	0,01
6,050 % fällig am 25.12.2036 ^		645	216	0,01
6,500 % fällig am 25.08.2032		40	39	0,00
6,500 % fällig am 25.09.2037 ^		562	231	0,01
Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust				
3,514 % fällig am 25.04.2035		29	23	0,00
3,573 % fällig am 20.05.2036 ^		648	596	0,02
3,677 % fällig am 20.02.2036		496	425	0,01
3,734 % fällig am 20.04.2036 ^		2	2	0,00
3,937 % fällig am 20.05.2036		361	325	0,01
4,241 % fällig am 20.07.2034		76	70	0,00
5,250 % fällig am 25.12.2027 ^		22	14	0,00
5,500 % fällig am 25.11.2035 ^		4	2	0,00
5,610 % fällig am 25.05.2035		36	30	0,00
5,730 % fällig am 25.04.2035		26	24	0,00
5,730 % fällig am 25.04.2035		14	13	0,00
5,750 % fällig am 25.02.2037 ^		365	175	0,01
5,750 % fällig am 25.05.2037 ^		23	12	0,00
5,750 % fällig am 25.08.2037		2.073	1.133	0,03
5,790 % fällig am 25.03.2035		265	219	0,01
5,810 % fällig am 25.02.2035		37	32	0,00
5,890 % fällig am 25.02.2035		773	668	0,02
5,910 % fällig am 20.02.2036 ^		25	21	0,00
6,000 % fällig am 25.09.2037 ^		85	46	0,00
6,500 % fällig am 25.12.2037		1.430	629	0,02
Countrywide Home Loan Reperforming REMIC Trust				
6,500 % fällig am 25.11.2034 ^		15	13	0,00
6,500 % fällig am 25.03.2035 ^		403	389	0,01
Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp.				
5,449 % fällig am 25.03.2032		27	25	0,00
6,000 % fällig am 25.01.2036 ^		480	306	0,01
6,500 % fällig am 25.04.2033		3	3	0,00
Credit Suisse First Boston Mortgage-Backed Pass-through Certificates				
5,276 % fällig am 25.10.2033		8	8	0,00
Credit Suisse Mortgage Capital Certificates				
3,519 % fällig am 30.11.2037		3.809	3.497	0,10
Credit Suisse Mortgage Capital Mortgage-Backed Trust				
5,750 % fällig am 25.02.2037		3.804	1.801	0,05
6,250 % fällig am 25.08.2036 ^		43	17	0,00
7,000 % fällig am 25.08.2037 ^		375	240	0,01
Credit Suisse Mortgage Capital Trust				
3,474 % fällig am 25.06.2050		1.844	1.548	0,05
Deutsche ALT-A Securities Mortgage Loan Trust				
5,290 % fällig am 25.07.2047		373	341	0,01
5,450 % fällig am 25.03.2037 ^		238	225	0,01
5,450 % fällig am 25.09.2047 ^		688	586	0,02
5,480 % fällig am 25.08.2037 ^		1.400	1.187	0,04

BESCHREIBUNG		PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
Downey Savings & Loan Association Mortgage Loan Trust				
5,235 % fällig am 19.07.2044	$	192	$ 175	0,01
5,347 % fällig am 19.10.2036		611	507	0,02
Dutch Property Finance BV				
3,892 % fällig am 28.07.2054	€	1.369	1.490	0,04
EMF-NL Prime BV				
3,977 % fällig am 17.04.2041		1.163	1.213	0,04
European Loan Conduit DAC				
4,358 % fällig am 17.02.2030		4.109	4.389	0,13
Eurosail BV				
4,677 % fällig am 17.10.2040		270	295	0,01
Eurosail PLC				
3,719 % fällig am 13.03.2045		3.632	3.694	0,11
5,240 % fällig am 13.03.2045	£	7.250	8.623	0,26
5,463 % fällig am 10.06.2044		6.316	7.695	0,23
5,940 % fällig am 13.06.2045		10.049	12.343	0,37
First Horizon Alternative Mortgage Securities Trust				
4,802 % fällig am 25.01.2036 ^	$	313	168	0,01
5,184 % fällig am 25.09.2034		45	40	0,00
First Horizon Mortgage Pass-Through Trust				
4,715 % fällig am 25.08.2035		24	17	0,00
Friary PLC				
5,467 % fällig am 21.11.2067	£	574	733	0,02
GMAC Mortgage Corp. Loan Trust				
3,281 % fällig am 19.04.2036 ^	$	45	36	0,00
Great Hall Mortgages PLC				
5,644 % fällig am 18.06.2039		15	15	0,00
GreenPoint Mortgage Funding Trust				
5,690 % fällig am 25.11.2045		147	130	0,00
5,770 % fällig am 25.10.2045		12	11	0,00
GSR Mortgage Loan Trust				
1,500 % fällig am 25.01.2037 (a)		3.079	295	0,01
3,657 % fällig am 25.11.2035		55	49	0,00
3,957 % fällig am 25.11.2035 ^		90	52	0,00
4,070 % fällig am 25.09.2035		141	133	0,00
5,750 % fällig am 25.03.2036 ^		9	9	0,00
5,750 % fällig am 25.01.2037 ^		18	11	0,00
6,000 % fällig am 25.03.2032		0	0	0,00
6,000 % fällig am 25.11.2035 ^		832	344	0,01
6,000 % fällig am 25.03.2037 ^		47	27	0,00
6,000 % fällig am 25.05.2037 ^		126	92	0,00
6,500 % fällig am 25.09.2036 ^		79	39	0,00
HarborView Mortgage Loan Trust				
3,687 % fällig am 19.10.2033		28	24	0,00
4,423 % fällig am 19.06.2045 ^		1.099	562	0,02
5,310 % fällig am 25.05.2038		485	389	0,01
5,597 % fällig am 19.05.2035		142	130	0,00
5,657 % fällig am 19.01.2036		671	416	0,01
5,717 % fällig am 19.02.2036		222	116	0,00
5,977 % fällig am 19.11.2034 ^		77	65	0,00
Harmony French Home Loans				
4,107 % fällig am 27.05.2062	€	6.132	6.719	0,20
HomeBanc Mortgage Trust				
3,912 % fällig am 25.04.2037 ^	$	1.616	1.414	0,04
Impac CMB Trust				
5,790 % fällig am 25.09.2034		2	2	0,00
5,790 % fällig am 25.03.2035		331	303	0,01
5,810 % fällig am 25.03.2035		329	300	0,01
5,930 % fällig am 25.10.2034		254	247	0,01
6,070 % fällig am 25.11.2034		14	14	0,00
IndyMac Adjustable Rate Mortgage Trust				
3,686 % fällig am 25.01.2032		13	12	0,00
IndyMac Mortgage Loan Trust				
3,082 % fällig am 25.06.2037		866	479	0,01
3,334 % fällig am 25.07.2037		2.042	1.333	0,04
3,717 % fällig am 25.06.2036		251	216	0,01
3,747 % fällig am 25.06.2037 ^		64	44	0,00
3,917 % fällig am 25.07.2037		454	191	0,01
4,009 % fällig am 25.10.2034		212	202	0,01
5,510 % fällig am 25.07.2047		583	406	0,01
5,570 % fällig am 25.07.2036		761	702	0,02
5,750 % fällig am 25.07.2035		210	171	0,01
5,790 % fällig am 25.02.2035		55	49	0,00
5,950 % fällig am 25.11.2034		96	86	0,00
5,970 % fällig am 25.11.2034 ^		70	60	0,00
6,500 % fällig am 25.07.2037 ^		3.037	1.006	0,03
JPMorgan Alternative Loan Trust				
3,814 % fällig am 25.03.2036 ^	$	201	$ 147	0,00
5,510 % fällig am 25.06.2037		9.361	5.107	0,15
5,843 % fällig am 26.05.2037		1.014	766	0,02
JPMorgan Mortgage Trust				
3,655 % fällig am 27.07.2037		126	114	0,00
3,921 % fällig am 25.11.2035 ^		21	17	0,00
3,963 % fällig am 25.12.2034		18	17	0,00
3,987 % fällig am 25.05.2034		6	5	0,00
4,078 % fällig am 25.10.2035 ^		152	122	0,00
4,172 % fällig am 25.04.2036 ^		8	6	0,00
5,750 % fällig am 25.01.2036 ^		52	26	0,00
6,000 % fällig am 25.08.2037 ^		262	142	0,00
6,250 % fällig am 25.07.2036 ^		144	56	0,00
6,500 % fällig am 25.08.2036 ^		251	91	0,00
Jubilee Place BV				
4,177 % fällig am 17.10.2057	€	443	484	0,01
Lehman Mortgage Trust				
5,890 % fällig am 25.04.2036 ^	$	1.032	681	0,02
Lehman XS Trust				
5,600 % fällig am 25.08.2046		145	140	0,00
6,050 % fällig am 25.08.2047 ^		503	422	0,01
Luminent Mortgage Trust				
5,510 % fällig am 25.12.2036 ^		18	17	0,00
Mansard Mortgages PLC				
4,885 % fällig am 15.04.2049	£	3.064	3.605	0,11
MASTR Adjustable Rate Mortgages Trust				
3,244 % fällig am 25.07.2035 ^	$	183	157	0,01
4,265 % fällig am 25.05.2034		49	44	0,00
4,560 % fällig am 21.11.2034		116	109	0,00
MASTR Seasoned Securitization Trust				
4,590 % fällig am 25.10.2032		70	68	0,00
Mellon Residential Funding Corp. Mortgage Pass-Through Certificates				
5,893 % fällig am 15.11.2031		22	21	0,00
Mellon Residential Funding Corp. Mortgage Pass-Through Trust				
5,633 % fällig am 15.12.2030		204	193	0,01
Merrill Lynch Mortgage Investors Trust				
3,738 % fällig am 25.03.2036 ^		497	280	0,01
3,918 % fällig am 25.05.2033		52	50	0,00
4,159 % fällig am 25.02.2035		11	10	0,00
4,343 % fällig am 25.07.2035 ^		31	28	0,00
5,650 % fällig am 25.11.2035		42	40	0,00
5,823 % fällig am 25.10.2028		12	11	0,00
7,119 % fällig am 25.12.2032		5	4	0,00
Morgan Stanley Mortgage Loan Trust				
3,103 % fällig am 25.11.2037		1.568	1.038	0,03
3,732 % fällig am 25.12.2037		1.280	890	0,03
5,410 % fällig am 25.04.2035		41	39	0,00
5,962 % fällig am 25.06.2036 ^		734	222	0,01
6,354 % fällig am 25.08.2036 ^		786	157	0,01
Morgan Stanley Re-REMIC Trust				
5,250 % fällig am 26.05.2037		864	454	0,01
MortgageIT Securities Corp. Mortgage Loan Trust				
5,610 % fällig am 25.06.2047		1.445	1.175	0,04
Newgate Funding PLC				
3,420 % fällig am 01.12.2050	€	3.974	4.134	0,12
Nomura Asset Acceptance Corp. Alternative Loan Trust				
3,834 % fällig am 25.10.2035	$	121	70	0,00
4,680 % fällig am 25.06.2036		1.301	984	0,03
6,220 % fällig am 25.02.2035		296	291	0,01
NovaStar Mortgage Funding Trust				
0,440 % fällig am 25.09.2046		1.873	656	0,02
OBX Trust				
5,800 % fällig am 25.06.2057		179	170	0,01
Opteum Mortgage Acceptance Corp. Asset-Backed Pass-Through Certificates				
5,675 % fällig am 25.12.2035		0	0	0,00
Polaris PLC				
6,154 % fällig am 27.05.2057	£	1.263	1.608	0,05
Precise Mortgage Funding PLC				
5,657 % fällig am 16.10.2056		459	583	0,02
Prime Mortgage Trust				
8,000 % fällig am 25.07.2034	$	334	259	0,01
RBSGC Structured Trust				
5,500 % fällig am 25.11.2035 ^		734	617	0,02
RBSSP Resecuritization Trust				
5,378 % fällig am 27.06.2036	$	4.946	$ 3.915	0,12
Residential Accredit Loans, Inc. Trust				
4,398 % fällig am 25.10.2037		168	149	0,00
4,834 % fällig am 25.12.2035 ^		158	129	0,00
4,951 % fällig am 25.01.2036 ^		205	147	0,00
5,300 % fällig am 25.02.2047		2.608	987	0,03
5,450 % fällig am 25.08.2035		192	146	0,00
5,476 % fällig am 25.08.2035		51	42	0,00
5,530 % fällig am 25.09.2036 ^		647	598	0,02
5,530 % fällig am 25.12.2036		371	325	0,01
5,530 % fällig am 25.05.2047		359	320	0,01
5,550 % fällig am 25.11.2036 ^		108	76	0,00
5,650 % fällig am 25.08.2037		93	85	0,00
5,710 % fällig am 25.12.2045		67	53	0,00
6,000 % fällig am 25.08.2036 ^		304	248	0,01
6,500 % fällig am 25.09.2037 ^		110	88	0,00
Residential Asset Securitization Trust				
5,500 % fällig am 25.06.2033		42	39	0,00
5,500 % fällig am 25.09.2035 ^		17	8	0,00
5,500 % fällig am 25.12.2035 ^		81	40	0,00
5,750 % fällig am 25.02.2036 ^		125	51	0,00
6,000 % fällig am 25.07.2037 ^		387	168	0,01
6,250 % fällig am 25.08.2037		2.324	642	0,02
Residential Funding Mortgage Securities, Inc. Trust				
4,149 % fällig am 25.09.2035 ^		325	211	0,01
4,573 % fällig am 25.04.2037 ^		30	23	0,00
4,978 % fällig am 27.07.2037 ^		257	211	0,01
6,500 % fällig am 25.03.2032		23	22	0,00
RESIMAC Bastille Trust				
6,093 % fällig am 05.09.2057		1.072	1.072	0,03
Resloc UK PLC				
3,706 % fällig am 15.12.2043	€	2.163	2.169	0,07
3,776 % fällig am 15.12.2043		4.251	4.206	0,13
5,221 % fällig am 15.12.2043	£	5.802	6.948	0,21
Rochester Financing PLC				
5,602 % fällig am 18.12.2044		1.640	2.060	0,06
Sequoia Mortgage Trust				
3,271 % fällig am 20.01.2047 ^	$	135	89	0,00
4,601 % fällig am 20.04.2035		47	46	0,00
5,840 % fällig am 20.07.2033		23	20	0,00
Shamrock Residential DAC				
4,289 % fällig am 24.01.2061	€	2.895	3.126	0,09
Stratton BTL Mortgage Funding PLC				
5,221 % fällig am 20.01.2054	£	3.139	3.970	0,12
Stratton Mortgage Funding PLC				
5,765 % fällig am 12.03.2052		1.571	1.990	0,06
5,991 % fällig am 20.07.2060		10.705	13.552	0,40
Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust				
3,853 % fällig am 25.04.2036 ^	$	119	73	0,00
4,455 % fällig am 25.09.2035		79	71	0,00
4,702 % fällig am 25.04.2035		134	126	0,00
4,968 % fällig am 25.10.2035 ^		162	145	0,00
4,984 % fällig am 25.09.2034		226	215	0,01
5,282 % fällig am 25.02.2034		116	109	0,00
5,404 % fällig am 25.04.2035		250	231	0,01
5,450 % fällig am 25.09.2034		4	3	0,00
5,578 % fällig am 25.07.2034		121	116	0,00
5,701 % fällig am 25.04.2034		1	0	0,00
6,063 % fällig am 25.12.2034		14	13	0,00
Structured Asset Mortgage Investments Trust				
5,270 % fällig am 25.08.2036		638	554	0,02
5,490 % fällig am 25.03.2037 ^		63	18	0,00
5,510 % fällig am 25.07.2046		380	316	0,01
5,530 % fällig am 25.06.2036		59	58	0,00
5,550 % fällig am 25.10.2036		1.272	1.110	0,03
5,570 % fällig am 25.04.2036		306	271	0,01
5,570 % fällig am 25.08.2036 ^		61	50	0,00
5,646 % fällig am 19.07.2035		126	119	0,00
5,770 % fällig am 25.12.2035 ^		164	133	0,00
Structured Asset Securities Corp. Mortgage Pass-Through Certificates				
6,434 % fällig am 25.12.2033		63	59	0,00
6,639 % fällig am 25.06.2033		1	1	0,00
Thornburg Mortgage Securities Trust				
3,889 % fällig am 25.07.2036		148	122	0,00
5,830 % fällig am 25.04.2043		11	11	0,00
6,400 % fällig am 25.06.2037 ^		375	344	0,01
7,151 % fällig am 25.06.2037		2.288	1.951	0,06

BESCHREIBUNG		PARI (000S)		MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
Towd Point Mortgage Funding PLC					
5,635 % fällig am 20.10.2051	£	11.512	$	14.657	0,44
5,841 % fällig am 20.07.2045		2.938		3.738	0,11
Tower Bridge Funding PLC					
5,629 % fällig am 20.12.2063		2.170		2.746	0,08
Trinity Square PLC					
5,316 % fällig am 15.07.2059		2.039		2.589	0,08
Twin Bridges PLC					
5,715 % fällig am 12.03.2055		3.581		4.536	0,14
WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust					
3,320 % fällig am 25.05.2037 ^	$	27		21	0,00
3,704 % fällig am 25.02.2037 ^		152		128	0,00
3,727 % fällig am 25.12.2046		180		171	0,01
3,754 % fällig am 25.09.2036 ^		318		273	0,01
3,772 % fällig am 25.02.2037 ^		1.204		1.081	0,03
3,824 % fällig am 25.06.2037 ^		74		66	0,00
3,883 % fällig am 25.03.2036		10		9	0,00
4,008 % fällig am 25.12.2046		115		102	0,00
4,134 % fällig am 25.08.2034		74		70	0,00
4,163 % fällig am 25.09.2033		21		19	0,00
4,220 % fällig am 25.10.2034		2		2	0,00
4,280 % fällig am 25.03.2034		259		255	0,01
4,676 % fällig am 25.02.2047 ^		600		512	0,02
4,706 % fällig am 25.01.2047		160		150	0,01
4,716 % fällig am 25.01.2047 ^		55		50	0,00
4,726 % fällig am 25.06.2047 ^		5		3	0,00
4,736 % fällig am 25.04.2047		1.035		913	0,03
4,956 % fällig am 25.06.2046		273		250	0,01
4,976 % fällig am 25.02.2046		340		303	0,01
4,976 % fällig am 25.08.2046		370		346	0,01
5,024 % fällig am 25.07.2046		238		200	0,01
5,024 % fällig am 25.08.2046		2.851		2.350	0,07
5,376 % fällig am 25.06.2042		10		9	0,00
5,376 % fällig am 25.08.2042		45		43	0,00
5,476 % fällig am 25.11.2046		1.981		1.748	0,05
5,670 % fällig am 25.11.2045		786		729	0,02
5,730 % fällig am 25.07.2045		129		120	0,00
5,730 % fällig am 25.10.2045		205		194	0,01
5,990 % fällig am 25.07.2045		202		190	0,01
Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates Trust					
4,696 % fällig am 25.12.2046		3.124		2.543	0,08
5,470 % fällig am 25.02.2037 ^		209		159	0,01
5,500 % fällig am 25.07.2035 ^		395		355	0,01
5,750 % fällig am 25.11.2035 ^		319		280	0,01
5,750 % fällig am 25.01.2036 ^		339		264	0,01
5,750 % fällig am 25.07.2036 ^		1.356		774	0,02
6,000 % fällig am 25.10.2035 ^		144		108	0,00
6,000 % fällig am 25.03.2036 ^		258		239	0,01
Washington Mutual MSC Mortgage Pass-Through Certificates Trust					
3,610 % fällig am 25.02.2033		0		0	0,00
Wells Fargo Alternative Loan Trust					
5,500 % fällig am 25.06.2037 ^		247		174	0,01
				278.047	8,26

FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE

BESCHREIBUNG		PARI (000S)		MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
Accredited Mortgage Loan Trust					
6,095 % fällig am 25.09.2035		6.171		4.990	0,15
Accunia European CLO DAC					
4,107 % fällig am 15.10.2030	€	1.939		2.100	0,06
4,127 % fällig am 15.07.2030		2.981		3.211	0,10
ACE Securities Corp. Home Equity Loan Trust					
5,390 % fällig am 25.08.2036 ^	$	1.537		390	0,01
5,975 % fällig am 25.12.2045 ^		983		745	0,02
Ameriquest Mortgage Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates					
5,855 % fällig am 25.11.2035		3.349		3.260	0,10
6,020 % fällig am 25.01.2036		600		559	0,02
6,170 % fällig am 25.09.2034		1.271		1.233	0,04
AMMC CLO Ltd.					
6,549 % fällig am 02.11.2030		2.332		2.323	0,07
Amortizing Residential Collateral Trust					
5,850 % fällig am 25.10.2031		22		21	0,00
Amresco Residential Securities Corp. Mortgage Loan Trust					
6,090 % fällig am 25.06.2029		6		5	0,00
Aqueduct European CLO DAC					
3,840 % fällig am 20.07.2030	€	2.304		2.481	0,07
Ares European CLO DAC					
4,050 % fällig am 20.04.2032	€	2.900	$	3.105	0,09
4,325 % fällig am 21.10.2033		8.500		9.120	0,27
Argent Securities Trust					
5,300 % fällig am 25.09.2036	$	2.031		669	0,02
5,370 % fällig am 25.05.2036		542		135	0,00
5,450 % fällig am 25.06.2036		1.692		473	0,01
5,450 % fällig am 25.07.2036		5.817		4.961	0,15
5,470 % fällig am 25.05.2036		3.630		900	0,03
Argent Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates					
5,630 % fällig am 25.05.2035		2.000		1.803	0,05
Armada Euro CLO DAC					
3,897 % fällig am 15.07.2031	€	1.549		1.654	0,05
Asset-Backed Funding Certificates Trust					
5,260 % fällig am 25.01.2037	$	1.011		586	0,02
5,310 % fällig am 25.01.2037		413		239	0,01
5,850 % fällig am 25.06.2034		712		692	0,02
6,200 % fällig am 25.03.2034 ^		352		328	0,01
Asset-Backed Securities Corp. Home Equity Loan Trust					
6,245 % fällig am 25.02.2035		822		830	0,02
Aurium CLO DAC					
3,907 % fällig am 16.01.2031	€	5.692		6.090	0,18
4,618 % fällig am 23.03.2032		5.000		5.373	0,16
Avoca CLO DAC					
3,867 % fällig am 15.07.2030		4.285		4.598	0,14
3,885 % fällig am 12.01.2031		2.154		2.308	0,07
4,067 % fällig am 15.04.2033		3.500		3.728	0,11
Babson CLO Ltd.					
6,240 % fällig am 20.01.2031	$	5.575		5.528	0,16
Barings CLO Ltd.					
6,210 % fällig am 15.04.2031		5.000		4.938	0,15
Barings Euro CLO DAC					
4,302 % fällig am 25.11.2029	€	2.327		2.526	0,08
Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust					
4,037 % fällig am 25.07.2036	$	43		41	0,00
4,477 % fällig am 25.11.2035 ^		768		721	0,02
4,800 % fällig am 25.06.2043		51		45	0,00
5,087 % fällig am 25.08.2034		146		141	0,00
5,368 % fällig am 25.02.2036		1.262		1.258	0,04
5,380 % fällig am 25.02.2037		3.784		3.442	0,10
5,450 % fällig am 25.11.2036		1.124		1.081	0,03
5,500 % fällig am 25.08.2036		13		13	0,00
6,005 % fällig am 25.07.2034		1.529		1.472	0,04
6,200 % fällig am 25.08.2037		93		78	0,00
Belle Haven ABS CDO Ltd.					
5,156 % fällig am 03.11.2044		11.399		3.438	0,10
Black Diamond CLO DAC					
4,060 % fällig am 20.01.2032	€	1.088		1.170	0,04
4,303 % fällig am 15.05.2032		5.500		5.871	0,17
Blackrock European CLO DAC					
3,797 % fällig am 15.10.2031		3.100		3.305	0,10
BlueMountain CLO Ltd.					
6,340 % fällig am 15.07.2031	$	3.900		3.849	0,11
BlueMountain Fuji EUR CLO DAC					
1,050 % fällig am 15.01.2031	€	497		500	0,02
3,897 % fällig am 15.01.2031		9.445		10.096	0,30
4,007 % fällig am 15.04.2034		2.200		2.340	0,07
BNPP AM Euro CLO DAC					
3,827 % fällig am 15.10.2031		1.478		1.577	0,05
4,031 % fällig am 22.07.2032		5.800		6.183	0,18
Bosphorus CLO DAC					
4,346 % fällig am 15.12.2030		1.202		1.291	0,04
4,496 % fällig am 12.12.2032		3.400		3.627	0,11
Cairn CLO BV					
3,957 % fällig am 15.10.2031		5.300		5.668	0,17
Cairn CLO DAC					
3,842 % fällig am 30.04.2031		2.168		2.318	0,07
3,912 % fällig am 31.01.2030		3.664		3.937	0,12
4,212 % fällig am 20.10.2028		36		39	0,00
Carlyle Euro CLO DAC					
3,877 % fällig am 15.01.2031		6.471		6.912	0,21
3,953 % fällig am 15.08.2030		1.449		1.545	0,05
Carlyle Global Market Strategies Euro CLO DAC					
4,137 % fällig am 16.01.2033		5.600		5.921	0,18
Carlyle Global Market Strategies Euro CLO Ltd.					
4,073 % fällig am 15.11.2031		11.100		11.882	0,35
Carrington Mortgage Loan Trust					
5,310 % fällig am 25.10.2036	$	2.835	$	2.730	0,08
5,400 % fällig am 25.10.2036		936		735	0,02
5,630 % fällig am 25.06.2036		1.053		998	0,03
6,050 % fällig am 25.05.2034		421		402	0,01
Centex Home Equity Loan Trust					
6,080 % fällig am 25.09.2034		305		293	0,01
CIT Mortgage Loan Trust					
6,500 % fällig am 25.10.2037		357		357	0,01
6,650 % fällig am 25.10.2037		10.500		10.222	0,30
Citigroup Mortgage Loan Trust					
5,320 % fällig am 25.07.2045		1.345		939	0,03
5,350 % fällig am 25.05.2037		4.048		2.671	0,08
5,470 % fällig am 25.12.2036		249		162	0,01
5,650 % fällig am 25.08.2036		2.644		2.564	0,08
5,670 % fällig am 25.09.2036		678		589	0,02
7,250 % fällig am 25.05.2036		539		287	0,01
Citigroup Mortgage Loan Trust Asset-Backed Pass-Through Certificates					
6,095 % fällig am 25.10.2034		315		298	0,01
Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.					
5,410 % fällig am 25.03.2037		418		354	0,01
Clarinda Park CLO DAC					
4,223 % fällig am 15.02.2034	€	7.550		8.044	0,24
Contego CLO DAC					
3,851 % fällig am 23.01.2030		4.189		4.480	0,13
Countrywide Asset-Backed Certificates					
5,830 % fällig am 25.12.2036 ^	$	89		66	0,00
Countrywide Asset-Backed Certificates Trust					
4,450 % fällig am 25.10.2032 ^		1.002		974	0,03
4,473 % fällig am 25.07.2036		2.669		2.386	0,07
5,290 % fällig am 25.06.2035		430		374	0,01
5,290 % fällig am 25.07.2037		1.222		1.111	0,03
5,290 % fällig am 25.08.2037 ^		157		138	0,00
5,330 % fällig am 25.11.2047 ^		46		51	0,00
5,350 % fällig am 25.09.2037		640		556	0,02
5,350 % fällig am 25.06.2047 ^		5.072		4.389	0,13
5,360 % fällig am 25.05.2047 ^		1.916		1.667	0,05
5,370 % fällig am 25.09.2037 ^		255		256	0,01
5,370 % fällig am 25.09.2047 ^		1.714		1.639	0,05
5,610 % fällig am 25.05.2037		236		222	0,01
5,859 % fällig am 25.10.2046 ^		17		17	0,00
6,095 % fällig am 25.08.2035		124		118	0,00
6,245 % fällig am 25.04.2036 ^		300		282	0,01
6,875 % fällig am 25.05.2035		752		739	0,02
7,100 % fällig am 25.08.2035		1.485		1.365	0,04
Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp.					
4,599 % fällig am 25.01.2032		2		2	0,00
Credit-Based Asset Servicing & Securitization LLC					
3,044 % fällig am 25.12.2036 ^		574		457	0,01
Credit-Based Asset Servicing & Securitization Mortgage Loan Trust					
3,287 % fällig am 25.03.2037 ^		9.571		3.650	0,11
Credit-Based Asset Servicing & Securitization Trust					
2,959 % fällig am 25.01.2037 ^		141		44	0,00
3,075 % fällig am 25.07.2036		1.974		1.839	0,05
3,156 % fällig am 25.01.2037 ^		145		45	0,00
CSAB Mortgage-Backed Trust					
6,220 % fällig am 25.09.2036 ^		3.475		1.157	0,03
CVC Cordatus Loan Fund DAC					
3,855 % fällig am 21.07.2030	€	12.782		13.715	0,41
4,156 % fällig am 15.09.2031		2.999		3.202	0,10
4,305 % fällig am 26.08.2032		500		534	0,02
Delta Funding Home Equity Loan Trust					
6,013 % fällig am 15.09.2029	$	5		5	0,00
Dryden Euro CLO DAC					
3,837 % fällig am 15.04.2033	€	8.900		9.498	0,28
4,157 % fällig am 17.01.2033		5.000		5.313	0,16
4,183 % fällig am 15.05.2034		5.800		6.192	0,18
EMC Mortgage Loan Trust					
5,890 % fällig am 25.05.2040	$	108		104	0,00
Euro-Galaxy CLO DAC					
3,831 % fällig am 24.04.2034	€	3.800		4.037	0,12
Fieldstone Mortgage Investment Trust					
5,458 % fällig am 25.11.2036	$	1.150		669	0,02
5,818 % fällig am 25.04.2047		3.908		2.758	0,08
First Franklin Mortgage Loan Trust					
5,430 % fällig am 25.12.2036		1.139		484	0,01

BESCHREIBUNG		PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
5,870 % fällig am 25.11.2035	$	1.290	$ 1.188	0,04
6,050 % fällig am 25.07.2035		1.916	1.875	0,06
First NLC Trust				
5,330 % fällig am 25.08.2037		6.912	3.544	0,11
Fremont Home Loan Trust				
5,280 % fällig am 25.11.2036		1.876	681	0,02
5,285 % fällig am 25.10.2036		3.444	3.034	0,09
5,350 % fällig am 25.08.2036		617	207	0,01
5,430 % fällig am 25.02.2037		7.396	5.699	0,17
5,490 % fällig am 25.02.2037		1.679	577	0,02
5,650 % fällig am 25.05.2036		1.299	768	0,02
5,765 % fällig am 25.11.2035		6.788	5.841	0,17
5,885 % fällig am 25.07.2035		21	21	0,00
6,020 % fällig am 25.05.2034		1.514	1.400	0,04
Gallatin CLO Ltd.				
6,311 % fällig am 21.01.2028		1.436	1.435	0,04
GE-WMC Mortgage Securities Trust				
5,450 % fällig am 25.08.2036		10.252	4.487	0,13
GoldenTree Loan Management EUR CLO DAC				
4,100 % fällig am 20.01.2032	€	2.900	3.085	0,09
4,220 % fällig am 20.07.2034		3.000	3.185	0,09
Greystone Commercial Real Estate Notes Ltd.				
6,373 % fällig am 15.09.2037	$	4.146	4.091	0,12
GSAA Home Equity Trust				
5,270 % fällig am 25.05.2036		643	161	0,01
5,290 % fällig am 25.03.2036		2.599	988	0,03
5,750 % fällig am 25.05.2047		112	75	0,00
5,985 % fällig am 25.06.2036		6.344	1.754	0,05
6,050 % fällig am 25.08.2037		86	83	0,00
6,502 % fällig am 25.11.2036		43	17	0,00
GSAMP Trust				
5,220 % fällig am 25.12.2036		331	162	0,01
5,350 % fällig am 25.11.2036		2.848	1.380	0,04
5,470 % fällig am 25.04.2036		35	22	0,00
5,670 % fällig am 25.06.2036		2.370	2.269	0,07
5,690 % fällig am 25.04.2036		552	347	0,01
Harvest CLO DAC				
4,250 % fällig am 26.06.2030	€	11.521	12.316	0,37
Home Equity Asset Trust				
6,140 % fällig am 25.01.2035	$	3	3	0,00
6,245 % fällig am 25.05.2035		157	155	0,00
Home Equity Mortgage Loan Asset-Backed Trust				
5,310 % fällig am 25.07.2037		786	421	0,01
5,370 % fällig am 25.04.2037		892	666	0,02
5,390 % fällig am 25.04.2037		895	584	0,02
HSI Asset Securitization Corp. Trust				
5,340 % fällig am 25.01.2037		860	595	0,02
5,370 % fällig am 25.12.2036		4.254	1.155	0,03
5,590 % fällig am 25.12.2036		3.862	1.043	0,03
5,675 % fällig am 25.02.2036		7.100	6.055	0,18
5,930 % fällig am 25.01.2036		9.668	7.567	0,22
IXIS Real Estate Capital Trust				
5,610 % fällig am 25.01.2037		272	99	0,00
JPMorgan Mortgage Acquisition Trust				
4,459 % fällig am 25.01.2037 ^		837	458	0,01
5,410 % fällig am 25.06.2037		56	55	0,00
5,450 % fällig am 25.07.2036		647	290	0,01
5,555 % fällig am 25.07.2036		2.467	2.390	0,07
Jubilee CLO DAC				
3,827 % fällig am 15.04.2031	€	3.100	3.298	0,10
LCM LP				
6,290 % fällig am 20.10.2027	$	138	138	0,00
Lehman XS Trust				
4,284 % fällig am 25.06.2036		754	707	0,02
5,470 % fällig am 25.05.2036		1.872	1.613	0,05
Long Beach Mortgage Loan Trust				
5,370 % fällig am 25.11.2036		9.357	2.973	0,09
5,590 % fällig am 25.02.2036		1.670	1.617	0,05
5,750 % fällig am 25.02.2036		263	216	0,01
5,795 % fällig am 25.11.2035		449	445	0,01
6,065 % fällig am 25.08.2035		700	618	0,02
Madison Park Euro Funding DAC				
3,927 % fällig am 15.01.2032	€	9.800	10.468	0,31
Madison Park Funding Ltd.				
6,010 % fällig am 15.04.2029	$	3.800	3.759	0,11
Man GLG Euro CLO DAC				
4,047 % fällig am 15.01.2030	€	308	332	0,01
4,216 % fällig am 15.12.2031		3.497	3.746	0,11
Massachusetts Educational Financing Authority				
6,205 % fällig am 25.04.2038	$	434	$ 434	0,01
MASTR Specialized Loan Trust				
5,500 % fällig am 25.05.2037		74	67	0,00
5,520 % fällig am 25.01.2037		1.211	492	0,01
Merrill Lynch Mortgage Investors Trust				
5,410 % fällig am 25.03.2037		2.365	2.069	0,06
5,470 % fällig am 25.03.2037		833	731	0,02
5,490 % fällig am 25.07.2037		57	25	0,00
5,584 % fällig am 25.04.2037		1.414	698	0,02
5,630 % fällig am 25.08.2037		11.798	6.167	0,18
5,670 % fällig am 25.05.2037		1.065	620	0,02
Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust				
5,210 % fällig am 25.12.2036		1.133	563	0,02
5,280 % fällig am 25.10.2036		666	589	0,02
5,290 % fällig am 25.10.2036		27	12	0,00
5,290 % fällig am 25.11.2036		720	341	0,01
5,290 % fällig am 25.05.2037		2.954	2.571	0,08
5,300 % fällig am 25.10.2036		6.625	3.499	0,10
5,300 % fällig am 25.11.2036		1.082	596	0,02
5,300 % fällig am 25.12.2036		232	115	0,00
5,330 % fällig am 25.03.2037		1.071	473	0,01
5,370 % fällig am 25.10.2036		1.071	466	0,01
5,380 % fällig am 25.10.2036		3.917	2.075	0,06
5,400 % fällig am 25.07.2036		740	638	0,02
5,400 % fällig am 25.03.2037		536	237	0,01
5,450 % fällig am 25.06.2036		14	12	0,00
5,450 % fällig am 25.07.2036		1.518	582	0,02
5,450 % fällig am 25.09.2036		66	25	0,00
5,930 % fällig am 25.01.2035		1.083	1.045	0,03
6,200 % fällig am 25.09.2033		63	62	0,00
6,400 % fällig am 25.07.2037		2.100	1.760	0,05
Morgan Stanley Capital, Inc. Trust				
5,510 % fällig am 25.03.2036		1.085	876	0,03
Morgan Stanley IXIS Real Estate Capital Trust				
5,450 % fällig am 25.07.2036		1.585	646	0,02
Morgan Stanley Mortgage Loan Trust				
6,465 % fällig am 25.09.2046 ^		1.039	353	0,01
Navient Student Loan Trust				
6,200 % fällig am 27.12.2066		3.713	3.678	0,11
New Century Home Equity Loan Trust				
5,870 % fällig am 25.03.2035		552	531	0,02
Newcastle Investment Trust				
0,000 % fällig am 01.05.2033		1.249	1.218	0,04
Nomura Home Equity Loan, Inc. Home Equity Loan Trust				
5,300 % fällig am 25.07.2036		1.831	1.724	0,05
5,810 % fällig am 25.10.2036 ^		2.154	487	0,01
5,950 % fällig am 25.02.2037 ^		582	173	0,01
6,035 % fällig am 25.09.2035		98	95	0,00
NovaStar Mortgage Funding Trust				
5,310 % fällig am 25.09.2037		604	597	0,02
5,350 % fällig am 25.09.2037		628	609	0,02
5,490 % fällig am 25.11.2036		2.153	673	0,02
5,570 % fällig am 25.01.2037		1.393	488	0,01
7,025 % fällig am 25.03.2035		846	830	0,02
OCP Euro CLO DAC				
3,997 % fällig am 15.01.2032	€	3.948	4.252	0,13
4,091 % fällig am 22.09.2034		6.800	7.226	0,21
4,713 % fällig am 20.01.2033		10.000	10.893	0,32
Octagon Investment Partners Ltd.				
6,230 % fällig am 15.04.2031	$	850	844	0,03
Option One Mortgage Loan Trust				
5,290 % fällig am 25.01.2037		842	549	0,02
5,290 % fällig am 25.02.2037		819	538	0,02
5,290 % fällig am 25.03.2037		146	131	0,00
5,370 % fällig am 25.04.2037		4.599	3.274	0,10
5,370 % fällig am 25.05.2037		3.711	2.189	0,07
5,885 % fällig am 25.08.2035		38	37	0,00
Ownit Mortgage Loan Trust				
5,438 % fällig am 25.05.2037		636	483	0,01
OZLM Ltd.				
6,348 % fällig am 16.05.2030		3.406	3.382	0,10
OZLME DAC				
4,162 % fällig am 24.08.2030	€	2.924	3.128	0,09
Palmer Square European Loan Funding DAC				
3,907 % fällig am 15.07.2031		8.592	9.154	0,27
3,957 % fällig am 15.04.2031		4.714	5.053	0,15
5,025 % fällig am 12.04.2032		9.262	10.159	0,30
Palmerston Park CLO DAC				
3,825 % fällig am 18.04.2030	€	1.590	$ 1.712	0,05
Park Place Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates				
6,095 % fällig am 25.06.2035	$	399	395	0,01
6,470 % fällig am 25.01.2036 ^		1.700	1.547	0,05
People's Choice Home Loan Securities Trust				
6,095 % fällig am 25.05.2035 ^		2.711	2.435	0,07
6,500 % fällig am 25.01.2035		414	393	0,01
Popular ABS Mortgage Pass-Through Trust				
5,360 % fällig am 25.01.2037		874	842	0,03
RAAC Trust				
5,750 % fällig am 25.06.2044		121	100	0,00
5,910 % fällig am 25.10.2046		1.369	1.297	0,04
6,005 % fällig am 25.03.2037		28	28	0,00
6,350 % fällig am 25.10.2045		154	150	0,00
Red & Black Auto Germany				
3,888 % fällig am 15.09.2031	€	2.023	2.214	0,07
Regatta Funding Ltd.				
6,330 % fällig am 17.07.2031	$	1.000	991	0,03
Renaissance Home Equity Loan Trust				
3,269 % fällig am 25.09.2037		708	495	0,01
5,612 % fällig am 25.04.2037		3.152	897	0,03
5,850 % fällig am 25.08.2032		10	9	0,00
Residential Asset Mortgage Products Trust				
5,890 % fällig am 25.05.2037		2.562	2.241	0,07
Residential Asset Securities Corp. Trust				
5,490 % fällig am 25.11.2036		1.914	1.793	0,05
5,490 % fällig am 25.04.2037		2.662	2.475	0,07
5,670 % fällig am 25.07.2036 ^		885	783	0,02
5,690 % fällig am 25.07.2036		1.249	1.074	0,03
Saxon Asset Securities Trust				
5,490 % fällig am 25.10.2046		255	247	0,01
Sculptor European CLO DAC				
3,916 % fällig am 14.01.2032	€	6.100	6.538	0,19
Securitized Asset-Backed Receivables LLC Trust				
5,470 % fällig am 25.10.2036	$	9.702	3.377	0,10
5,810 % fällig am 25.08.2035 ^		1.855	1.430	0,04
5,915 % fällig am 25.02.2034		225	224	0,01
6,110 % fällig am 25.01.2036 ^		239	209	0,01
SG Mortgage Securities Trust				
5,360 % fällig am 25.10.2036		1.800	1.247	0,04
Sierra Madre Funding Ltd.				
5,571 % fällig am 07.09.2039		1.933	1.385	0,04
5,591 % fällig am 07.09.2039		11.090	7.959	0,24
Soundview Home Loan Trust				
5,230 % fällig am 25.06.2037		585	394	0,01
5,270 % fällig am 25.11.2036		268	78	0,00
5,320 % fällig am 25.07.2037		781	642	0,02
5,320 % fällig am 25.08.2037		2.161	1.830	0,05
5,360 % fällig am 25.06.2037		2.710	1.825	0,05
5,430 % fällig am 25.06.2037		3.905	2.630	0,08
5,710 % fällig am 25.10.2036		375	363	0,01
6,050 % fällig am 25.10.2037		4.992	3.940	0,12
Specialty Underwriting & Residential Finance Trust				
3,597 % fällig am 25.09.2037		473	160	0,01
3,700 % fällig am 25.02.2037 ^		1.504	587	0,02
4,460 % fällig am 25.12.2036		999	936	0,03
St. Paul's CLO DAC				
3,927 % fällig am 15.01.2032	€	1.294	1.388	0,04
Structured Asset Investment Loan Trust				
6,125 % fällig am 25.01.2035	$	4.321	3.866	0,12
6,275 % fällig am 25.01.2035		418	347	0,01
6,725 % fällig am 25.01.2035		456	341	0,01
6,875 % fällig am 25.01.2035 ^		321	130	0,00
Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust				
5,305 % fällig am 25.09.2036		7.280	4.577	0,14
5,330 % fällig am 25.01.2037		849	510	0,02
5,650 % fällig am 25.11.2037		2.123	1.946	0,06
6,155 % fällig am 25.11.2035		6.700	6.583	0,20
6,670 % fällig am 25.04.2035		53	52	0,00
Structured Asset Securities Corp. Trust				
5,840 % fällig am 25.09.2035		4.099	3.880	0,12
Symphony CLO Ltd.				
6,140 % fällig am 15.04.2028		271	270	0,01
Tikehau CLO DAC				
4,144 % fällig am 04.08.2034	€	500	533	0,02

BESCHREIBUNG		PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
Toro European CLO DAC				
3,995 % fällig am 12.01.2032	€	6.200	$ 6.635	0,20
4,097 % fällig am 15.07.2030		423	459	0,01
Triaxx Prime CDO Ltd.				
5,453 % fällig am 02.10.2039	$	1.842	34	0,00
Voya Euro CLO DAC				
3,927 % fällig am 15.10.2030	€	2.156	2.323	0,07
WaMu Asset-Backed Certificates WaMu Trust				
5,300 % fällig am 25.01.2037	$	9.863	4.536	0,13
5,375 % fällig am 25.05.2037		3.333	3.054	0,09
Washington Mutual Asset-Backed Certificates Trust				
5,450 % fällig am 25.05.2036		822	621	0,02
5,630 % fällig am 25.05.2036		672	510	0,02
Wells Fargo Home Equity Asset-Backed Securities Trust				
5,750 % fällig am 25.04.2037		2.967	2.045	0,06
6,875 % fällig am 25.11.2035		5.889	5.798	0,17
Willow Park CLO DAC				
4,017 % fällig am 15.01.2031	€	873	939	0,03
			600.484	17,83
STAATSEMISSIONEN				
Argentina Government International Bond				
0,500 % fällig am 09.07.2030	$	3.875	1.221	0,04
1,000 % fällig am 09.07.2029		483	158	0,00
1,500 % fällig am 09.07.2035		10.189	3.062	0,09
15,500 % fällig am 17.10.2026	ARS	17.300	7	0,00
Mexico Government International Bond				
6,350 % fällig am 09.02.2035	$	3.700	3.899	0,12
Peru Government International Bond				
5,940 % fällig am 12.02.2029	PEN	3.800	1.030	0,03
Provincia de Buenos Aires				
88,734 % fällig am 12.04.2025 (a)	ARS	315.510	571	0,02
Republic of Greece Government International Bond				
1,875 % fällig am 24.01.2052	€	1.700	1.186	0,04
3,750 % fällig am 30.01.2028		360	397	0,01
3,900 % fällig am 30.01.2033		2.035	2.282	0,07
4,000 % fällig am 30.01.2037		1.120	1.239	0,04
Romania Government International Bond				
1,750 % fällig am 13.07.2030		5.100	4.254	0,13
Russia Government International Bond				
4,250 % fällig am 23.06.2027 ^	$	400	174	0,01
4,750 % fällig am 27.05.2026 ^		400	202	0,01
5,250 % fällig am 23.06.2047 ^		200	89	0,00
5,250 % fällig am 23.06.2047 ^		600	36	0,00
5,625 % fällig am 04.04.2042 ^		200	136	0,00
South Africa Government International Bond				
4,850 % fällig am 30.09.2029		10.100	8.904	0,26
10,500 % fällig am 21.12.2026	ZAR	894.100	49.153	1,46
Turkey Government International Bond				
5,750 % fällig am 22.03.2024	$	1.800	1.774	0,05
6,350 % fällig am 10.08.2024		9.400	9.255	0,27
			89.029	2,65

BESCHREIBUNG		AKTIEN	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
STAMMAKTIEN				
KOMMUNIKATIONSDIENSTE				
Intelsat Emergence S.A. (d)(j)		19.324	$ 444	0,01
LUXUSGÜTER				
Royal Caribbean Cruises Ltd. (d)		5.356	556	0,02
ENERGIE				
Constellation Oil Services Holding S.A. 'B' (d)(j)		1.038.200	112	0,00
FINANZWERTE				
National Bank of Greece S.A. (d)		307.710	2.000	0,06
IMMOBILIEN				
Adler Group S.A. (d)		33.602	18	0,00
Adler Group S.A.		74.405	45	0,00
			63	0,00
			3.175	0,09
RECHTE				
Intelsat Jackson Holdings S.A. - Exp. 05.12.2025		4.046	24	0,00
OPTIONSSCHEINE				
Constellation Oil Services Holding S.A. 'D' - Exp. 10.06.2071 (j)		1	0	0,00
VORZUGSWERTPAPIERE				
Nationwide Building Society 10,250 % (g)		6.982	1.023	0,03
		PARI (000S)		
KURZFRISTIGE INSTRUMENTE				
KURZFRISTIGE SCHULDTITEL				
Warnermedia Holdings, Inc. 3,528 % fällig am 15.03.2024	$	3.100	3.045	0,09
ARGENTINA TREASURY BILLS				
(54,758) % fällig am 18.09.2023 (e)(f)	ARS	50.061	99	0,00
(28,578) % fällig am 18.10.2023 (e)(f)		620.219	1.226	0,04
(12,549) % fällig am 23.11.2023 (e)(f)		1.637.189	3.302	0,10
			4.627	0,14
HUNGARY TREASURY BILLS				
16,220 % fällig am 06.07.2023 (e)(f)	HUF	13.520.000	39.465	1,17

BESCHREIBUNG		PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
JAPAN TREASURY BILLS				
(0,197) % fällig am 31.07.2023 (e)(f)	¥	10.079.000	$ 69.741	2,07
(0,178) % fällig am 31.07.2023 (e)(f)		13.391.000	92.658	2,75
			162.399	4,82
U.S. TREASURY BILLS				
5,129 % fällig am 01.08.2023 (e)(f)	$	25.200	25.097	0,75
5,242 % fällig am 20.07.2023 (e)(f)		23.800	23.744	0,71
5,259 % fällig am 17.08.2023 (b)(e)(f)(l)		3.200	3.179	0,09
5,290 % fällig am 24.08.2023 (e)(f)		147.400	146.298	4,35
5,364 % fällig am 31.08.2023 (e)(f)(l)		4.900	4.859	0,14
			203.177	6,04
Summe kurzfristige Instrumente			412.713	12,26
Summe Übertragbare Wertpapiere			**$ 3.011.520**	**89,43**
		AKTIEN		
INVESTMENTFONDS				
ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN				
PIMCO Funds: Global Investors Series plc - Asia Strategic Interest Bond Fund (h)		1.496.908	13.382	0,40
PIMCO Funds: Global Investors Series plc - PIMCO Asia High Yield Bond Fund (h)		770.713	7.006	0,21
PIMCO Funds: Global Investors Series plc - US Short-Term Fund (h)		9.515.532	95.536	2,83
PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (h)		8.926.571	88.891	2,64
			204.815	6,08
BÖRSENGEHANDELTE FONDS				
PIMCO ETFs plc - PIMCO US Dollar Short Maturity UCITS ETF (h)		1.328.250	131.935	3,92
Summe Investmentfonds			**$ 336.750**	**10,00**

PENSIONSGESCHÄFTE

Kontrahent	Kredit-zins	Abrechnungs-datum	Fälligkeits-datum	Kapital-betrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensions-geschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensions-geschäft[1]	% des Nettovermögens
BRC	5,130 %	30.06.2023	03.07.2023	$ 466.900	Fannie Mae 4,000 % - 5,000 % fällig am 01.05.2051 - 01.09.2052	$ (395.977)	$ 466.900	$ 467.100	13,87
					Ginnie Mae 2,500 % fällig am 20.08.2051	(83.801)			
FICC	2,400	30.06.2023	03.07.2023	3.658	U.S. Treasury Notes 4,625 % fällig am 30.06.2025	(3.731)	3.658	3.658	2,53
SAL	5,130	30.06.2023	03.07.2023	85.300	U.S. Treasury Notes 0,250 % fällig am 31.07.2025	(87.091)	85.300	85.336	0,11
Summe Pensionsgeschäfte						**$ (570.600)**	**$ 555.858**	**$ 556.094**	**16,51**

(1) Umfasst aufgelaufene Zinsen.

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

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

FUTURES

Beschreibung	Art	Ablauf-monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Euro-Bobl September Futures	Short	09.2023	925	$ 1.704	0,05
Euro-Bund 10-Year Bond September Futures	Short	09.2023	614	806	0,03
Euro-Schatz September Futures	Short	09.2023	1.140	1.055	0,03
U.S. Treasury 2-Year Note September Futures	Long	09.2023	2.230	(6.300)	(0,19)
U.S. Treasury 5-Year Note September Futures	Long	09.2023	4.343	(8.652)	(0,26)
U.S. Treasury 10-Year Note September Futures	Short	09.2023	4.710	8.302	0,25
U.S. Treasury 10-Year Ultra September Futures	Short	09.2023	919	768	0,02
U.S. Treasury 30-Year Bond September Futures	Short	09.2023	536	(56)	0,00
U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond September Futures	Short	09.2023	877	(1.710)	(0,05)
				$ (4.083)	(0,12)

VERKAUFSOPTIONEN

OPTIONEN AUF BÖRSENGEHANDELTE TERMINKONTRAKTE

Beschreibung	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Anzahl der Kontrakte	Aufgeld	Markt-wert	% des Nettovermögens
Call - CME-Kaufoptionen mit Ausübungskurs bei 98,000 USD auf 3-Month SOFR December Futures	$ 98,000	15.12.2023	4	$ (3)	$ 0	0,00
Put - CME-Verkaufsoptionen mit Ausübungskurs bei 96,500 USD auf 3-Month SOFR December Futures	96,500	15.12.2023	4	(4)	(19)	0,00
				$ (7)	$ (19)	0,00
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate					**$ (4.102)**	**(0,12)**

ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)

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

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMMISSIONEN - SCHUTZVERKAUF[1]

Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag[3]	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
AES Corp.	5,000 %	20.12.2025	$ 500	$ (47)	0,00
AT&T, Inc.	1,000	20.06.2024	5.300	39	0,00
AT&T, Inc.	1,000	20.06.2026	2.700	(30)	0,00
AT&T, Inc.	1,000	20.06.2028	300	2	0,00
Boeing Co.	1,000	20.06.2026	100	2	0,00
British Telecommunications PLC	1,000	20.12.2024	€ 7.000	47	0,00
General Electric Co.	1,000	20.06.2026	$ 4.300	3	0,00
General Electric Co.	1,000	20.12.2026	400	0	0,00
Tesco PLC	1,000	20.06.2028	€ 4.300	23	0,00
				$ 39	0,00

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES - SCHUTZKAUF[2]

Index/Tranchen	Zu bezahlender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag[3]	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
CDX.EM-33 5-Year Index	(1,000) %	20.06.2025	$ 87	$ (5)	0,00
CDX.HY-40 5-Year Index	(5,000)	20.06.2028	45.800	(1.070)	(0,03)
				$ (1.075)	(0,03)

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES - SCHUTZVERKAUF[1]

Index/Tranchen	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag[3]	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
CDX.IG-35 5-Year Index	1,000 %	20.12.2025	$ 200	$ (1)	0,00
CDX.IG-36 5-Year Index	1,000	20.06.2026	700	(7)	0,00
CDX.IG-40 5-Year Index	1,000	20.06.2028	3.300	23	0,00
iTraxx Crossover 39 5-Year Index	5,000	20.06.2028	€ 15.400	530	0,01
				$ 545	0,01

ZINSSWAPS

Zahlung/ Erhalt variabel Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits-datum		Nenn-betrag		Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Zahlung[4]	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	3,500 %	20.09.2033	£	93.300	$	(5.114)	(0,15)
Erhalt[4]	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	3,750	20.09.2028		80.100		5.110	0,15
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	0,000	04.08.2023	$	345.100		4.761	0,14
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	0,000	20.09.2023		104.830		(1.465)	(0,04)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,270	04.11.2023		345.100		(6.839)	(0,20)
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,750	21.12.2052		24.100		1.788	0,05
Zahlung[4]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,827	03.07.2028		85.800		(7.981)	(0,23)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,857	15.07.2032		29.520		(4.158)	(0,12)
Erhalt[4]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,999	03.07.2053		17.500		3.896	0,12
Erhalt[4]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,000	10.12.2029		40		5	0,00
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,250	20.06.2028		104.830		2.496	0,07
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,000	21.06.2033		31.200		78	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,080	23.02.2053		2.500		(46)	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,370	01.03.2033		3.500		(59)	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,405	01.03.2033		3.700		(52)	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,425	01.03.2033		3.600		(46)	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,430	27.02.2033		8.400		(104)	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,450	07.03.2033		7.300		(79)	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,470	22.02.2030		9.600		(161)	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,800	10.03.2028		7.400		(61)	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	10,206	04.01.2027	BRL	13.900		(63)	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,045	04.01.2027		136.700		161	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,050	04.01.2027		126.600		154	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,086	04.01.2027		82.400		100	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,098	04.01.2027		126.200		163	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,115	04.01.2027		271.000		2.201	0,07
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,460	04.01.2027		145.000		641	0,02
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,734	02.01.2025		127.000		(15)	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,800	02.01.2025		128.000		16	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,814	04.01.2027		76.300		447	0,01
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,835	02.01.2025		129.000		33	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,868	04.01.2027		68.000		420	0,01
Zahlung	1-Year BRL-CDI	12,500	04.01.2027		185.800		1.850	0,05
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	2,000	14.11.2023	CAD	54.100		(664)	(0,02)
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	2,060	28.10.2023		516.600		(4.000)	(0,12)
Zahlung	3-Month CAD-CAONREPO Compounded-OIS	4,000	21.06.2025		387.200		(2.812)	(0,08)
Zahlung	3-Month NZD-BBR	3,000	01.11.2023	NZD	144.800		(1.242)	(0,04)
Zahlung	3-Month NZD-BBR	3,000	15.12.2023		203.200		(1.699)	(0,05)
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	0,000	04.08.2023	$	345.100		(4.734)	(0,14)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	0,000	20.09.2023		104.830		1.475	0,04
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,000	10.09.2023		40		0	0,00
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	0,650	12.04.2027	€	6.700		(712)	(0,02)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	0,650	11.05.2027		5.800		(604)	(0,02)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	0,700	11.04.2027		3.400		(356)	(0,01)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	1,000	13.05.2027		7.200		(675)	(0,02)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	1,000	18.05.2027		3.500		(328)	(0,01)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,250	28.04.2024		8.800		(131)	0,00
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,250	03.05.2024		9.000		(135)	0,00
Zahlung[4]	6-Month EUR-EURIBOR	3,000	20.09.2033		40.700		366	0,01
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR	6,160	16.09.2027	PLN	93.100		(1.562)	(0,05)
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR	6,210	26.04.2027		116.600		(1.061)	(0,03)
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR	6,240	23.09.2027		78.600		(1.399)	(0,04)
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR	6,250	23.09.2027		55.300		(990)	(0,03)
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR	6,270	20.09.2027		89.800		(1.621)	(0,05)
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR	6,280	26.09.2027		26.700		(490)	(0,01)
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR	6,310	19.09.2027		94.800		(1.757)	(0,05)
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR	6,985	11.10.2027		113.000		(2.969)	(0,09)
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR	7,156	13.10.2027		58.300		(1.643)	(0,05)
						$	(31.666)	(0,93)
Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate						**$**	**(32.157)**	**(0,95)**

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

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

(3) Der maximal mögliche Betrag, den der Fonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

(4) Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft.

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

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

OPTIONSKAUF

ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag[1]	Kosten	Markt-wert	% des Nettovermögens
BOA	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	0,021 %	25.10.2023	7.600	$ 434	$ 1.926	0,06
FAR	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	0,021	15.09.2023	12.200	640	2.939	0,09
MYC	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	0,021	15.09.2023	12.800	696	3.187	0,09
							$ 1.770	$ 8.052	0,24

VERKAUFSOPTIONEN

ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag[1]	Aufgeld	Markt-wert	% des Nettovermögens
BOA	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	0,020 %	25.10.2023	38.000	$ (435)	$ (3.420)	(0,10)
FAR	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	0,020	15.09.2023	61.000	(640)	(5.666)	(0,17)
GLM	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,018	20.10.2023	3.700	(24)	0	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,018	20.10.2023	3.700	(24)	(75)	0,00
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,140	23.10.2023	3.700	(26)	(1)	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,140	23.10.2023	3.700	(26)	(71)	0,00
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,190	23.10.2023	3.700	(26)	(1)	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,190	23.10.2023	3.700	(26)	(69)	0,00
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,225	23.10.2023	3.700	(26)	(1)	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,225	23.10.2023	3.700	(26)	(68)	0,00
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,973	25.10.2023	3.700	(25)	0	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,973	25.10.2023	3.700	(25)	(77)	0,00
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,841	27.10.2023	3.700	(25)	0	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,841	27.10.2023	3.700	(25)	(81)	(0,01)
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,250	07.12.2023	10.800	(34)	(1)	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,750	07.12.2023	10.800	(34)	(135)	(0,01)
JPM	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,250	20.07.2023	6.400	(22)	(8)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,650	20.07.2023	6.400	(22)	(26)	0,00
MYC	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	0,020	15.09.2023	64.000	(697)	(6.032)	(0,18)
							$ (2.188)	$ (15.732)	(0,47)

(1) Der Nennbetrag stellt die Anzahl der Kontrakte dar.

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMMISSIONEN - SCHUTZVERKAUF[1]

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitstermin	Nenn-betrag[2]	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Markt-wert	% des Nettovermögens
BOA	Turkey Government International Bond	1,000 %	20.12.2023	$ 2.100	$ (154)	$ 145	$ (9)	0,00
BRC	Turkey Government International Bond	1,000	20.12.2023	200	(14)	13	(1)	0,00
CBK	Brazil Government International Bond	1,000	20.12.2024	100	(2)	3	1	0,00
GST	Brazil Government International Bond	1,000	20.12.2024	400	(6)	9	3	0,00
	South Africa Government International Bond	1,000	20.06.2024	15.500	(686)	688	2	0,00
	Turkey Government International Bond	1,000	20.06.2024	300	(37)	31	(6)	0,00
HUS	Brazil Government International Bond	1,000	20.12.2023	200	(6)	7	1	0,00
	Brazil Government International Bond	1,000	20.06.2024	1.100	(32)	40	8	0,00
JPM	South Africa Government International Bond	1,000	20.12.2023	200	(12)	12	0	0,00
MYC	California State General Obligation Bonds, Series 2003	1,000	20.09.2024	2.900	23	9	32	0,00
					$ (926)	$ 957	$ 31	0,00

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES - SCHUTZVERKAUF[1]

Kontrahent	Index/Tranchen	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitstermin	Nenn-betrag[2]	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Markt-wert	% des Nettovermögens
GST	CMBX.NA.AAA.10 Index	0,500 %	17.11.2059	$ 800	$ (24)	$ 21	$ (3)	0,00
MYC	CMBX.NA.AAA.10 Index	0,500	17.11.2059	11.000	(379)	334	(45)	0,00
UAG	CMBX.NA.AAA.10 Index	0,500	17.11.2059	10.900	(378)	334	(44)	0,00
					$ (781)	$ 689	$ (92)	0,00

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

(2) Der maximal mögliche Betrag, den der Fonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung		Zu erhaltende Währung		Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
AZD	07.2023	AUD	3.106	$	2.061	$ 0	$ (6)	$ (6)	0,00
	07.2023	$	380	AUD	581	6	0	6	0,00
	08.2023		2.063		3.106	6	0	6	0,00
BOA	07.2023	¥	330.100	$	2.344	60	0	60	0,00
	07.2023	MXN	75.161		4.083	0	(289)	(289)	(0,01)
	07.2023	PLN	19.596		4.700	0	(120)	(120)	0,00
	07.2023	$	3.054	AUD	4.677	59	0	59	0,00
	07.2023		142	DKK	964	0	(1)	(1)	0,00
	07.2023		2.924	£	2.317	22	0	22	0,00
	07.2023		406	PEN	1.489	4	0	4	0,00
	07.2023		3.800	PLN	15.765	77	0	77	0,00
	08.2023	DKK	962	$	142	1	0	1	0,00
	08.2023	NZD	756		479	16	0	16	0,00
	08.2023	$	490	CNY	3.364	0	(25)	(25)	0,00
	08.2023		808	ZAR	14.777	0	(29)	(29)	0,00
	08.2023	ZAR	1.949	$	101	0	(2)	(2)	0,00
	09.2023	HKD	6.434		823	1	0	1	0,00
	09.2023	KRW	71.850		57	2	0	2	0,00
	09.2023	TWD	1.292		43	1	0	1	0,00
	09.2023	$	8.467	INR	700.307	46	0	46	0,00
BPS	07.2023	AUD	2.220	$	1.471	0	(7)	(7)	0,00
	07.2023	DKK	535		77	0	(1)	(1)	0,00
	07.2023	£	177		219	0	(6)	(6)	0,00
	07.2023	PLN	6.174		1.497	0	(21)	(21)	0,00
	07.2023	$	88	BRL	425	0	0	0	0,00
	07.2023		4.133	€	3.783	0	(5)	(5)	0,00
	07.2023		1.130	£	882	0	(9)	(9)	0,00
	07.2023		52.799	¥	7.339.012	0	(2.023)	(2.023)	(0,06)
	07.2023		266	PLN	1.100	5	0	5	0,00
	08.2023	BRL	425	$	87	0	0	0	0,00
	08.2023	CNH	2.554		370	17	0	17	0,00
	08.2023	TWD	647		21	0	0	0	0,00
	08.2023	$	1.472	AUD	2.220	7	0	7	0,00
	08.2023		579	CNY	3.956	0	(31)	(31)	0,00
	08.2023		242	ZAR	4.512	0	(5)	(5)	0,00
	08.2023	ZAR	32.267	$	1.758	57	0	57	0,00
	09.2023	$	177	PEN	648	1	0	1	0,00
	10.2023	ZAR	264.036	$	14.186	356	0	356	0,01
BRC	07.2023	PLN	5.604		1.342	0	(36)	(36)	0,00
	08.2023	$	2.436	COP	10.375.848	19	0	19	0,00
	08.2023		295	ZAR	5.460	0	(8)	(8)	0,00
	09.2023		62	ILS	221	0	(2)	(2)	0,00
	09.2023		164	PEN	600	1	0	1	0,00
BSH	07.2023		1.315		4.838	20	0	20	0,00
CBK	07.2023	CAD	3.496	$	2.565	0	(76)	(76)	0,00
	07.2023	CLP	6.717.507		8.300	0	(65)	(65)	0,00
	07.2023	PEN	9.420		2.594	0	(5)	(5)	0,00
	07.2023	$	1.317	AUD	2.019	27	0	27	0,00
	07.2023		8.776	€	8.100	64	(3)	61	0,00
	07.2023		4.380	PEN	16.175	81	0	81	0,00
	07.2023		931	PLN	3.833	11	0	11	0,00
	08.2023	PEN	10.169	$	2.603	0	(192)	(192)	(0,01)
	08.2023	TWD	623		20	0	0	0	0,00
	08.2023	$	8.329	CLP	6.814.398	105	0	105	0,00
CLY	07.2023	DKK	1.558	$	225	0	(3)	(3)	0,00
DUB	07.2023	PEN	9.420		2.576	0	(23)	(23)	0,00
	07.2023	$	24.689	BRL	133.775	3.043	0	3.043	0,09
	07.2023		5.168	PEN	18.841	28	0	28	0,00
	09.2023		9		34	0	0	0	0,00
GLM	07.2023	BRL	134.200	$	27.793	0	(26)	(26)	0,00
	07.2023	$	18.415	MXN	323.929	440	0	440	0,01
	07.2023		1.175	PLN	4.929	37	0	37	0,00
	09.2023		27.793	BRL	135.687	22	0	22	0,00
	10.2023	ZAR	27.186	$	1.449	25	0	25	0,00
JPM	07.2023	¥	2.386.857		16.690	176	0	176	0,01
	07.2023	$	2.937	AUD	4.493	53	0	53	0,00
	07.2023		659.427	€	603.926	0	(543)	(543)	(0,02)
	07.2023		474	PLN	2.010	20	0	20	0,00
	08.2023	CNH	2.050	$	297	14	0	14	0,00
	08.2023	€	603.926		660.349	563	0	563	0,02
	08.2023	HUF	24.175		69	0	(1)	(1)	0,00
	08.2023	$	610	CNY	4.173	0	(33)	(33)	0,00
	08.2023		757	HUF	260.912	0	(3)	(3)	0,00
	08.2023		16.690	¥	2.376.714	0	(177)	(177)	(0,01)
	08.2023		1.777	ZAR	32.513	0	(62)	(62)	0,00
	08.2023	ZAR	87	$	5	0	0	0	0,00
	09.2023	PEN	42.510		11.545	0	(112)	(112)	0,00
	09.2023	$	60	ILS	212	0	(2)	(2)	0,00
	09.2023		624	INR	51.438	1	0	1	0,00
	09.2023		2.680	PEN	9.788	4	0	4	0,00
	10.2023		8.427	MXN	147.958	34	0	34	0,00

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung		Zu erhaltende Währung		Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
MBC	07.2023	CAD	3.427	$	2.569	$ 0	$ (21)	$ (21)	0,00
	07.2023	€	1.916		2.049	0	(41)	(41)	0,00
	07.2023	£	144.165		178.456	0	(4.828)	(4.828)	(0,14)
	07.2023	$	2.592	€	2.416	44	0	44	0,00
	07.2023		1.027	£	824	21	0	21	0,00
	07.2023		93	PLN	403	6	0	6	0,00
	08.2023	HUF	828.406	$	2.428	35	0	35	0,00
	09.2023	KRW	133.187		104	3	0	3	0,00
MYI	07.2023	£	508		640	0	(5)	(5)	0,00
	07.2023	$	126	DKK	859	0	0	0	0,00
	07.2023		8	€	7	0	0	0	0,00
	07.2023		1.233	£	977	9	0	9	0,00
	07.2023		1.035	PLN	4.367	39	0	39	0,00
	08.2023	DKK	858	$	126	0	0	0	0,00
	08.2023	TWD	696		23	1	0	1	0,00
	09.2023	KRW	149.681		117	3	0	3	0,00
	09.2023	$	135	INR	11.110	0	0	0	0,00
RBC	07.2023		5.034	£	3.938	0	(27)	(27)	0,00
	07.2023		5	MXN	90	1	0	1	0,00
	08.2023	MXN	76.881	$	4.436	0	(10)	(10)	0,00
RYL	07.2023	$	33	PLN	138	1	0	1	0,00
SCX	07.2023	AUD	4.562	$	3.028	0	(8)	(8)	0,00
	07.2023	$	4.144	AUD	6.342	77	0	77	0,00
	08.2023	CNH	972	$	141	7	0	7	0,00
	08.2023	NZD	268		168	3	0	3	0,00
	08.2023	$	3.031	AUD	4.562	8	0	8	0,00
	08.2023		795	CNH	5.455	0	(42)	(42)	0,00
	08.2023		1.623	CNY	11.080	0	(90)	(90)	0,00
	09.2023	TWD	1.080	$	35	1	0	1	0,00
	09.2023	$	391	INR	32.170	0	0	0	0,00
	09.2023		975	PEN	3.591	10	0	10	0,00
SOG	07.2023	€	616.171	$	662.839	0	(9.404)	(9.404)	(0,28)
	07.2023	PLN	241.184		55.985	0	(3.329)	(3.329)	(0,10)
	07.2023	$	2.512	AUD	3.839	44	0	44	0,00
SSB	07.2023	¥	23.470.000	$	177.970	14.951	0	14.951	0,45
	07.2023	PEN	14.259		3.909	0	(22)	(22)	0,00
	07.2023	$	8.374	CLP	6.727.138	3	0	3	0,00
	08.2023	CLP	6.746.566	$	8.374	1	0	1	0,00
	08.2023	$	3.904	PEN	14.259	20	0	20	0,00
TOR	07.2023	AUD	5.614	$	3.708	0	(29)	(29)	0,00
	07.2023	$	1.329	AUD	2.032	24	0	24	0,00
	07.2023		5.232	CAD	6.923	4	(4)	0	0,00
	07.2023		173.299	£	136.381	89	0	89	0,00
	08.2023	CAD	6.920	$	5.232	4	(4)	0	0,00
	08.2023	£	136.381		173.337	0	(86)	(86)	0,00
	08.2023	HUF	15.313		44	0	(1)	(1)	0,00
	08.2023	$	3.711	AUD	5.614	29	0	29	0,00
UAG	07.2023	AUD	8.947	$	5.974	31	(12)	19	0,00
	07.2023	€	138		148	0	(2)	(2)	0,00
	07.2023	$	304	AUD	465	5	0	5	0,00
	08.2023		5.979		8.947	12	(31)	(19)	0,00
	08.2023	ZAR	678.817	$	35.349	10	(441)	(431)	(0,01)
	09.2023	SGD	23.771		17.786	171	0	171	0,01
	09.2023	$	51	ILS	184	0	(2)	(2)	0,00
	09.2023		8.014	INR	662.512	39	0	39	0,00
						$ 21.238	$ (22.391)	$ (1.153)	(0,04)

ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklasse Class Z AUD (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung		Zu erhaltende Währung		Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
AZD	07.2023	AUD	1.179	$	782	$ 0	$ (2)	$ (2)	0,00
	07.2023	$	1.499	AUD	2.291	26	0	26	0,00
	08.2023		783		1.179	2	0	2	0,00
BOA	07.2023	AUD	237	$	158	1	0	1	0,00
	07.2023	$	3.075	AUD	4.727	72	0	72	0,01
BPS	07.2023	AUD	6.229	$	4.127	1	(20)	(19)	0,00
	08.2023	$	3.962	AUD	5.976	20	0	20	0,00
CBK	07.2023	AUD	24	$	16	0	0	0	0,00
	07.2023	$	1.028	AUD	1.574	20	0	20	0,00
JPM	07.2023		1.533		2.345	28	0	28	0,00
MBC	07.2023	AUD	246	$	164	0	0	0	0,00
RBC	07.2023		101		68	1	0	1	0,00
SCX	07.2023		2.212		1.469	1	(4)	(3)	0,00
	07.2023	$	1.222	AUD	1.870	23	0	23	0,00
	08.2023		1.382		2.079	4	0	4	0,00
SOG	07.2023		2.439		3.728	42	0	42	0,00

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
TOR	07.2023	AUD 3.631	$ 2.398	$ 0	$ (19)	$ (19)	0,00
	07.2023	$ 2.592	AUD 3.963	46	0	46	0,00
	08.2023	2.400	3.631	19	0	19	0,00
UAG	07.2023	AUD 7.503	$ 4.989	15	(20)	(5)	0,00
	07.2023	$ 1.200	AUD 1.833	20	0	20	0,00
	08.2023	4.599	6.921	20	(9)	11	0,00
				$ 361	$ (74)	$ 287	0,01

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklasse Institutional CAD (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2023	$ 2.804	CAD 3.815	$ 79	$ 0	$ 79	0,01
CBK	07.2023	47	64	1	0	1	0,00
JPM	07.2023	2.811	3.814	71	0	71	0,00
MBC	07.2023	CAD 24	$ 18	0	0	0	0,00
SCX	07.2023	$ 2.811	CAD 3.818	74	0	74	0,00
				$ 225	$ 0	$ 225	0,01

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklassen Institutional CHF (Hedged) thesaurierend und Class E CHF (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BPS	07.2023	CHF 20.207	$ 22.594	$ 8	$ 0	$ 8	0,00
	07.2023	$ 34.628	CHF 31.324	385	0	385	0,01
	08.2023	22.594	20.149	0	(8)	(8)	0,00
CLY	07.2023	CHF 10.680	$ 11.890	0	(48)	(48)	0,00
	08.2023	$ 11.890	CHF 10.650	48	0	48	0,00
MBC	07.2023	CHF 9.238	$ 10.304	0	(22)	(22)	0,00
MYI	07.2023	2.713	3.035	3	0	3	0,00
	07.2023	$ 104	CHF 94	1	0	1	0,00
SCX	07.2023	25.909	23.280	112	0	112	0,01
UAG	07.2023	CHF 20.861	$ 23.271	0	(46)	(46)	0,00
	07.2023	$ 23.294	CHF 20.931	102	0	102	0,00
	08.2023	23.252	20.784	46	0	46	0,00
				$ 705	$ (124)	$ 581	0,02

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklassen Institutional EUR (Hedged) thesaurierend, Institutional EUR (Hedged) ausschüttend, Investor EUR (Hedged) thesaurierend, Administrative EUR (Hedged) thesaurierend, Class E EUR (Hedged) thesaurierend und G Retail EUR (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2023	€ 368	$ 399	$ 0	$ (3)	$ (3)	0,00
	07.2023	$ 83.445	€ 77.645	1.265	0	1.265	0,04
BPS	07.2023	€ 64.459	$ 70.625	302	(1)	301	0,01
	07.2023	$ 83.342	€ 77.527	1.240	0	1.240	0,04
	08.2023	69.680	63.505	0	(301)	(301)	(0,01)
CBK	07.2023	€ 68.333	$ 74.268	3	(287)	(284)	(0,01)
	07.2023	$ 700	€ 652	12	0	12	0,00
	08.2023	68.962	63.341	238	0	238	0,01
JPM	07.2023	€ 63.368	$ 69.192	57	0	57	0,00
	08.2023	$ 69.288	€ 63.368	0	(59)	(59)	0,00
MBC	07.2023	€ 36.882	$ 40.304	103	(38)	65	0,00
	07.2023	$ 49	€ 46	1	0	1	0,00
SOG	07.2023	83.399	77.527	1.183	0	1.183	0,03
				$ 4.404	$ (689)	$ 3.715	0,11

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklassen Institutional GBP (Hedged) thesaurierend, Institutional GBP (Hedged) ausschüttend und Class E GBP (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2023	$ 1.188	£ 942	$ 10	$ 0	$ 10	0,00
BPS	07.2023	832.907	673.387	23.205	(1)	23.204	0,69
BRC	07.2023	£ 53.910	$ 67.251	0	(1.287)	(1.287)	(0,04)
	07.2023	$ 1.659	£ 1.322	22	(1)	21	0,00
CBK	07.2023	£ 453	$ 577	1	0	1	0,00
	07.2023	$ 1.956	£ 1.549	14	0	14	0,00
JPM	07.2023	£ 654.483	$ 827.528	0	(4.549)	(4.549)	(0,14)
	08.2023	$ 827.704	£ 654.483	4.540	0	4.540	0,13
MBC	07.2023	831.823	671.949	22.463	(4)	22.459	0,67
MYI	07.2023	832.450	669.785	19.082	0	19.082	0,57
TOR	07.2023	£ 656.585	$ 834.323	0	(427)	(427)	(0,01)
	08.2023	$ 834.505	£ 656.585	412	0	412	0,01
				$ 69.749	$ (6.269)	$ 63.480	1,88

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklasse Institutional NOK (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung		Zu erhaltende Währung		Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2023	NOK	9	$	1	$ 0	$ 0	$ 0	0,00
	07.2023	$	113	NOK	1.243	3	0	3	0,00
BPS	07.2023	NOK	879	$	82	0	0	0	0,00
	08.2023	$	82	NOK	878	0	0	0	0,00
CBK	07.2023		101		1.138	5	0	5	0,00
GLM	07.2023	NOK	930	$	86	0	(1)	(1)	0,00
	08.2023	$	86	NOK	929	1	0	1	0,00
UAG	07.2023		90		999	3	0	3	0,00
						$ 12	$ (1)	$ 11	0,00

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklasse Administrative SEK (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung		Zu erhaltende Währung		Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2023	SEK	19.648	$	1.821	$ 2	$ 0	$ 2	0,00
	07.2023	$	16	SEK	173	0	0	0	0,00
	08.2023		1.808		19.483	0	(1)	(1)	0,00
BRC	07.2023	SEK	125	$	12	0	0	0	0,00
CBK	07.2023	$	1.190	SEK	13.001	13	0	13	0,00
GLM	07.2023	SEK	25	$	2	0	0	0	0,00
MBC	07.2023		18		2	0	0	0	0,00
	07.2023	$	1.237	SEK	13.320	0	(4)	(4)	0,00
MYI	07.2023	SEK	19.516	$	1.808	1	0	1	0,00
	07.2023	$	1.777	SEK	19.076	0	(11)	(11)	0,00
	08.2023		1.808		19.492	0	(1)	(1)	0,00
SCX	07.2023	SEK	80	$	7	0	0	0	0,00
	07.2023	$	1.237	SEK	13.381	2	0	2	0,00
						$ 18	$ (17)	$ 1	0,00
Summe Freiverkehrsfinanzderivate								**$ 59.406**	**1,76**

LEERVERKAUFTE WERTPAPIERE

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
US-REGIERUNGSBEHÖRDEN			
Uniform Mortgage-Backed Security, TBA			
2,000 % fällig am 01.07.2053	$ 96.900	$ (79.045)	(2,35)
2,000 % fällig am 01.08.2053	4.000	(3.268)	(0,09)
Summe Leerverkaufte Wertpapiere		**$ (82.313)**	**(2,44)**
Summe Anlagen		**$ 3.844.962**	**114,19**
Sonstige Aktiva und Passiva		**$ (477.669)**	**(14,19)**
Nettovermögen		**$ 3.367.293**	**100,00**

ERLÄUTERUNGEN ZUR AUFSTELLUNG DES WERTPAPIERBESTANDS (Angaben in Tausend*):

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

^ **Das Wertpapier ist in Verzug.**

(a) **Bei dem Wertpapier handelt es sich um ein Interest Only- („IO“) bzw. IO-Strip.**

(b) **Wertpapier per Emissionstermin.**

(c) **Wertpapier mit Sachwertausschüttung.**

(d) **Das Wertpapier hat in den letzten zwölf Monaten keine Erträge geliefert.**

(e) **Nullkuponwertpapier.**

(f) **Der Kupon stellt eine Rendite bis zur Endfälligkeit dar.**

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

(h) **Mit dem Fonds verbunden.**

(i) **Bedingt wandelbares Wertpapier.**

(i) Eingeschränkte Wertpapiere (31. Dezember 2022: 0,24 %):

Emittentenbeschreibung	Kauf-datum	Kosten	Markt-wert	% des Nettovermögens
Constellation Oil Services Holding S.A. 'B'	10.06.2022	$ 112	$ 112	0,00
Constellation Oil Services Holding S.A. 'D' - Exp. 10.06.2071	10.06.2022	0	0	0,00
Deutsche Bank AG 0,898 % fällig am 28.05.2024	25.05.2021	1.900	1.806	0,05
Deutsche Bank AG 3,035 % fällig am 28.05.2032	25.05.2021	800	631	0,02
Intelsat Emergence S.A.	05.09.2018	2.000	444	0,01
Morgan Stanley 0,000 % fällig am 02.04.2032	29.07.2022	2.458	2.250	0,07
		$ 7.270	$ 5.243	0,15

(k) Wertpapier mit einem gesamten beizulegenden Zeitwert von 213 USD (31. Dezember 2022: 2.041 USD) wurden zum 30. Juni 2023 gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte als Sicherheit verpfändet.

(l) Wertpapiere mit einem gesamten beizulegenden Zeitwert von 3.486 USD (31. Dezember 2022: null USD) und Barmittel in Höhe von 14.370 USD (31. Dezember 2022: 48.797 USD) wurden zum 30. Juni 2023 gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. als Sicherheit für Finanzderivate verpfändet.

Barmittel in Höhe von 55.345 USD (31. Dezember 2022: 45.907 USD) wurden zum 30. Juni 2023 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Beizulegender Zeitwert[1]

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 30. Juni 2023 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie[2]	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	$ 601	$ 3.006.528	$ 4.391	$ 3.011.520
Investmentfonds	336.750	0	0	336.750
Pensionsgeschäfte	0	555.858	0	555.858
Finanzderivate[3]	3.565	19.582	0	23.147
Leerverkaufte Wertpapiere	0	(82.313)	0	(82.313)
Summen	**$ 340.916**	**$ 3.499.655**	**$ 4.391**	**$ 3.844.962**

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

Kategorie[2]	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	$ 0	$ 2.707.373	$ 4.828	$ 2.712.201
Investmentfonds	217.139	131.583	0	348.722
Pensionsgeschäfte	0	1.145.692	0	1.145.692
Finanzderivate[3]	(2.766)	(83.089)	0	(85.855)
Leerverkaufte Wertpapiere	0	(82.152)	0	(82.152)
Summen	**$ 214.373**	**$ 3.819.407**	**$ 4.828**	**$ 4.038.608**

(1) Siehe Erläuterung 3 in den Erläuterungen zum Abschluss für weitere Informationen.

(2) Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung des Wertpapierbestands.

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

Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2023:

Kontrahent	Kredit-zins	Abrechnungs-datum	Fälligkeits-datum	Kredit-betrag	Verbindlichkeiten aus umgekehrten Pensions-geschäften	% des Nettovermögens
BRC	0,000 %	21.06.2023	TBD[1]	€ (199)	$ (217)	(0,01)
Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte					**$ (217)**	**(0,01)**

(1) Umgekehrtes Pensionsgeschäft mit offener Laufzeit.

Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC-Finanzderivate und -Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2023 und 31. Dezember 2022:

	Zum 30. Jun. 2023			Zum 31. Dez. 2022		
Kontrahent	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-Engagement[1]	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-Engagement[1]
AZD	$ 32	$ (30)	$ 2	$ 36	$ 0	$ 36
BOA	(252)	0	(252)	(3.100)	3.170	70
BPS	23.165	(16.310)	6.855	(3.900)	3.880	(20)
BRC	(1.293)	806	(487)	(359)	320	(39)
BSH	20	0	20	k. A.	k. A.	k. A.
CBK	(32)	0	(32)	4.410	(4.530)	(120)
CLY	(3)	0	(3)	(250)	0	(250)
DUB	3.048	(2.920)	128	24	(100)	(76)
FAR	(2.727)	2.640	(87)	(1.982)	1.690	(292)
GLM	(82)	0	(82)	(17.283)	17.179	(104)

	Zum 30. Jun. 2023			Zum 31. Dez. 2022		
Kontrahent	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-Engagement[1]	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-Engagement[1]
GST	$ (4)	$ 0	$ (4)	$ (48)	$ 208	$ 160
HUS	9	0	9	k. A.	k. A.	k. A.
JPM	(14)	0	(14)	(2.303)	310	(1.993)
MBC	17.718	(12.860)	4.858	2.683	(3.440)	(757)
MYC	(2.858)	2.780	(78)	(2.059)	1.970	(89)
MYI	19.122	(12.730)	6.392	1.202	(910)	292
RBC	(35)	0	(35)	(86)	60	(26)
RYL	1	0	1	(76)	0	(76)
SAL	k. A.	k. A.	k. A.	(40)	0	(40)
SCX	178	(100)	78	(8.642)	8.280	(362)
SOG	(11.464)	8.950	(2.514)	k. A.	k. A.	k. A.
SSB	14.953	(15.240)	(287)	(2.124)	1.540	(584)
TOR	57	0	57	(12.777)	9.630	(3.147)
UAG	(133)	2.680	2.547	(667)	560	(107)

(1) Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären.

Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung des Wertpapierbestands zum 30. Juni 2023:

	30. Jun. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	42,13	30,35
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	47,29	46,36
Sonstige übertragbare Wertpapiere	0,01	1,16
Investmentfonds	10,00	10,00
Pensionsgeschäfte	16,51	32,89
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	(0,12)	0,08
Zentral abgerechnete Finanzderivate	(0,95)	(1,19)
Freiverkehrsfinanzderivate	1,76	(1,36)
Leerverkaufte Wertpapiere	(2,44)	(2,36)
Umgekehrte Pensionsgeschäfte	(0,01)	(0,06)

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 30. Juni 2023 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	30. Jun. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
Kreditbeteiligungen und -abtretung	1,10	1,91
Unternehmensanleihen und Wechsel	23,48	22,11
Wandelanleihen & Wechsel	0,26	0,40
Kommunalanleihen und Wechsel	0,27	0,35
US-Regierungsbehörden	20,48	8,36
US-Schatzobligationen	2,72	2,61
Non-Agency-MBS	8,26	8,21
Forderungsbesicherte Wertpapiere	17,83	18,00
Staatsemissionen	2,65	3,20
Stammaktien	0,09	0,05
Bezugsrechte	0,00	0,00
Optionsscheine	0,00	0,00
Vorzugswertpapiere	0,03	0,17
Kurzfristige Instrumente	12,26	12,50
Investmentfonds	10,00	10,00
Pensionsgeschäfte	16,51	32,89
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	(0,12)	0,08
Verkaufsoptionen		
Optionen auf börsengehandelte Terminkontrakte	0,00	0,00
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen - Schutzverkauf	0,00	(0,03)
Credit Default Swaps auf Kreditindizes — Schutzkauf	(0,03)	0,00
Credit Default Swaps auf Kreditindizes — Schutzverkauf	0,01	0,03
Zinsswaps	(0,93)	(1,19)
Freiverkehrsfinanzderivate		
Optionskauf		
Zinsswapoptionen	0,24	0,34
Verkaufsoptionen		
Credit Default Swaptions auf Kreditindizes	k. A.	0,00
Zinsswapoptionen	(0,47)	(0,95)
Optionen auf Wertpapiere	k. A.	(0,01)
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen - Schutzverkauf	0,00	0,00
Credit Default Swaps auf Kreditindizes — Schutzverkauf	0,00	0,00
Zinsswaps	k. A.	0,02
Devisenterminkontrakte	(0,04)	(1,05)
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	2,03	0,29
Leerverkaufte Wertpapiere	(2,44)	(2,36)
Sonstige Aktiva und Passiva	(14,19)	(15,93)
Nettovermögen	100,00	100,00

BESCHREIBUNG		PARI (000S)		MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE					
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL					
BANKEN UND FINANZEN					
AMCO - Asset Management Co. SpA					
4,625 % fällig am 06.02.2027	€	4.800	€	4.772	0,11
American Express Co.					
4,900 % fällig am 13.02.2026	$	14.400		13.070	0,31
5,849 % fällig am 13.02.2026		14.400		13.173	0,31
Arkea Home Loans SFH S.A.					
3,000 % fällig am 30.03.2027	€	4.700		4.604	0,11
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A.					
5,875 % fällig am 24.09.2023 (e)(g)		1.000		992	0,02
5,875 % fällig am 24.09.2023 (e)		200		198	0,01
Banco Santander S.A.					
3,250 % fällig am 14.02.2028		3.500		3.447	0,08
Bank of America Corp.					
0,750 % fällig am 26.07.2023		15.000		14.975	0,35
Bank of Nova Scotia					
4,750 % fällig am 02.02.2026	$	7.500		6.769	0,16
Barclays PLC					
1,500 % fällig am 03.09.2023	€	7.000		6.973	0,16
7,750 % fällig am 15.09.2023 (e)(g)	$	2.400		2.161	0,05
CaixaBank S.A.					
6,750 % fällig am 13.06.2024 (e)(g)	€	400		388	0,01
Castellum AB					
2,125 % fällig am 20.11.2023		2.600		2.561	0,06
Commerzbank AG					
0,125 % fällig am 09.01.2024		5.500		5.400	0,13
Credit Suisse AG					
4,474 % fällig am 01.09.2023		5.000		4.997	0,12
6,500 % fällig am 08.08.2023 (g)	$	200		183	0,00
Credit Suisse AG AT1 Claim ^		3.400		125	0,00
Deutsche Bank AG					
1,125 % fällig am 30.08.2023	€	1.600		1.593	0,04
Digital Euro Finco LLC					
2,500 % fällig am 16.01.2026		900		839	0,02
DNB Bank ASA					
3,625 % fällig am 16.02.2027		7.700		7.545	0,18
DNB Boligkreditt A/S					
0,375 % fällig am 14.11.2023		3.800		3.756	0,09
Erste Group Bank AG					
6,500 % fällig am 15.04.2024 (e)(g)		600		582	0,01
Europäische Finanzstabilisierungsfazilität					
0,000 % fällig am 19.04.2024 (b)		15.000		14.590	0,34
Goldman Sachs Group, Inc.					
4,281 % fällig am 07.02.2025		17.700		17.774	0,42
HSBC Holdings PLC					
6,000 % fällig am 29.09.2023 (e)(g)		200		199	0,00
ING Bank NV					
3,000 % fällig am 15.02.2026		9.900		9.738	0,23
Intesa Sanpaolo SpA					
2,125 % fällig am 30.08.2023		11.400		11.371	0,27
6,250 % fällig am 16.05.2024 (e)(g)		200		195	0,00
KeyBank N.A.					
4,700 % fällig am 26.01.2026	$	14.600		12.466	0,29
Kreditanstalt fuer Wiederaufbau					
0,000 % fällig am 15.09.2023 (b)	€	2.500		2.484	0,06
0,500 % fällig am 15.09.2027		10.000		8.961	0,21
LeasePlan Corp. NV					
0,125 % fällig am 13.09.2023		2.800		2.779	0,07
Lloyds Bank PLC					
3,250 % fällig am 02.02.2026		3.100		3.053	0,07
Lloyds Banking Group PLC					
1,000 % fällig am 09.11.2023		1.000		990	0,02
Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc.					
6,029 % fällig am 20.02.2026	$	14.200		13.037	0,31
Mizuho Financial Group, Inc.					
1,020 % fällig am 11.10.2023	€	2.500		2.481	0,06
Nasdaq, Inc.					
3,850 % fällig am 30.06.2026	$	100		88	0,00
NatWest Group PLC					
2,000 % fällig am 04.03.2025	€	7.000		6.872	0,16
Nordea Bank Abp					
3,625 % fällig am 10.02.2026		1.900		1.874	0,04
Nordic Investment Bank					
3,875 % fällig am 19.02.2026	£	9.600	€	10.680	0,25
Societe Generale S.A.					
7,875 % fällig am 18.12.2023 (e)(g)	$	1.200		1.079	0,03
State Street Corp.					
4,857 % fällig am 26.01.2026		15.200		13.732	0,32
Stichting AK Rabobank Certificaten					
6,500 % (e)	€	1.051		977	0,02
Sumitomo Mitsui Banking Corp.					
2,750 % fällig am 24.07.2023		2.500		2.499	0,06
3,602 % fällig am 16.02.2026		1.600		1.580	0,04
Temasek Financial Ltd.					
3,250 % fällig am 15.02.2027		6.700		6.630	0,16
Toronto-Dominion Bank					
3,650 % fällig am 20.01.2025		12.900		12.933	0,30
				258.165	6,06
INDUSTRIEWERTE					
Amgen, Inc.					
5,150 % fällig am 02.03.2028	$	2.600		2.383	0,06
BMW Finance NV					
0,625 % fällig am 06.10.2023	€	900		893	0,02
CVS Health Corp.					
5,000 % fällig am 20.02.2026	$	29.300		26.742	0,63
Highland Holdings SARL					
0,000 % fällig am 12.11.2023 (b)	€	5.200		5.125	0,12
Oracle Corp.					
4,500 % fällig am 06.05.2028	$	868		774	0,02
SK Hynix, Inc.					
6,250 % fällig am 17.01.2026		16.200		14.860	0,35
Smurfit Kappa Acquisitions ULC					
2,875 % fällig am 15.01.2026	€	500		483	0,01
Union Pacific Corp.					
4,750 % fällig am 21.02.2026	$	14.600		13.298	0,31
				64.558	1,52
VERSORGUNGSUNTERNEHMEN					
Contemporary Ruiding Development Ltd.					
1,875 % fällig am 17.09.2025		4.800		4.039	0,10
EDP - Energias de Portugal S.A.					
2,375 % fällig am 27.11.2023	€	300		298	0,01
EP Infrastructure A/S					
1,698 % fällig am 30.07.2026		9.026		7.791	0,18
2,045 % fällig am 09.10.2028		6.974		5.492	0,13
Eurogrid GmbH					
1,625 % fällig am 03.11.2023		3.000		2.978	0,07
National Rural Utilities Cooperative Finance Corp.					
4,450 % fällig am 13.03.2026	$	2.989		2.699	0,06
NextEra Energy Capital Holdings, Inc.					
5,481 % fällig am 03.11.2023		8.250		7.561	0,18
Optus Finance Pty. Ltd.					
1,000 % fällig am 20.06.2029	€	700		576	0,01
				31.434	0,74
Summe Unternehmensanleihen und Wechsel				354.157	8,32
WANDELANLEIHEN & WECHSEL					
Luminar Technologies, Inc.					
1,250 % fällig am 15.12.2026	$	17.000		10.495	0,25
Sunnova Energy International, Inc.					
2,625 % fällig am 15.02.2028		5.400		4.064	0,09
				14.559	0,34
US-REGIERUNGSBEHÖRDEN					
Uniform Mortgage-Backed Security, TBA					
4,000 % fällig am 01.08.2053		210.900		181.632	4,26
4,500 % fällig am 01.07.2053		229.900		202.732	4,76
5,000 % fällig am 01.07.2053		268.200		240.950	5,66
5,500 % fällig am 01.08.2053		331.800		302.627	7,11
				927.941	21,79
US-SCHATZOBLIGATIONEN					
U.S. Treasury Inflation Protected Securities (d)					
0,625 % fällig am 15.07.2032		474.466		399.956	9,39
1,125 % fällig am 15.01.2033		182.369		160.257	3,77
1,625 % fällig am 15.10.2027	$	190.857		172.420	4,05
				732.633	17,21
NON-AGENCY-MBS					
Adjustable Rate Mortgage Trust					
4,328 % fällig am 25.04.2035		29		25	0,00
American Home Mortgage Assets Trust					
6,750 % fällig am 25.11.2046		57	€	46	0,00
Ashford Hospitality Trust					
6,319 % fällig am 15.06.2035		10.441		9.323	0,22
BCAP LLC Trust					
4,590 % fällig am 26.03.2037		293		259	0,01
6,450 % fällig am 25.09.2047		167		134	0,00
Bear Stearns Adjustable Rate Mortgage Trust					
3,605 % fällig am 25.07.2036 ^		437		338	0,01
Bear Stearns ALT-A Trust					
3,839 % fällig am 25.09.2047 ^		5.144		2.434	0,06
6,875 % fällig am 25.07.2034		840		778	0,02
Citigroup Mortgage Loan Trust					
3,974 % fällig am 25.09.2037 ^		50		40	0,00
Countrywide Alternative Loan Trust					
3,994 % fällig am 25.06.2037 ^		433		347	0,01
5,470 % fällig am 25.02.2047		55		46	0,00
5,750 % fällig am 25.08.2035		608		517	0,01
5,797 % fällig am 20.12.2035		97		83	0,00
6,000 % fällig am 25.01.2037		259		132	0,00
6,000 % fällig am 25.07.2037		106		50	0,00
Countrywide Asset-Backed Certificates Trust					
5,630 % fällig am 25.04.2036 ^		334		258	0,01
Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust					
3,884 % fällig am 25.11.2037		74		62	0,00
5,730 % fällig am 25.04.2035		1.645		1.393	0,03
5,750 % fällig am 25.05.2035		144		107	0,00
6,000 % fällig am 25.07.2036		67		33	0,00
6,500 % fällig am 25.12.2037		97		39	0,00
Countrywide Home Loan Reperforming REMIC Trust					
4,237 % fällig am 25.01.2034 ^		606		453	0,01
Downey Savings & Loan Association Mortgage Loan Trust					
5,347 % fällig am 19.10.2036		88		67	0,00
Dutch Property Finance BV					
4,168 % fällig am 28.04.2064	€	1.333		1.336	0,03
Formentera Issuer PLC					
5,357 % fällig am 28.07.2047	£	3.084		3.566	0,08
FWD Securitization Trust					
2,240 % fällig am 25.01.2050	$	122		102	0,00
GreenPoint Mortgage Funding Trust					
5,390 % fällig am 25.10.2045		924		825	0,02
GSMPS Mortgage Loan Trust					
5,500 % fällig am 25.03.2035		1.956		1.569	0,04
HarborView Mortgage Loan Trust					
5,567 % fällig am 19.12.2036		521		399	0,01
5,976 % fällig am 19.10.2035		80		41	0,00
Harbour					
5,358 % fällig am 28.01.2054	£	1.396		1.621	0,04
Impac CMB Trust					
5,790 % fällig am 25.03.2035	$	46		39	0,00
IndyMac Mortgage Loan Trust					
3,442 % fällig am 25.08.2037		2.781		1.736	0,04
3,758 % fällig am 25.06.2036		1.646		1.245	0,03
5,510 % fällig am 25.02.2037 ^		76		62	0,00
5,730 % fällig am 25.01.2036		503		315	0,01
JPMorgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust					
4,248 % fällig am 05.07.2033		1.000		827	0,02
6,363 % fällig am 05.07.2033		968		812	0,02
Kentmere PLC					
5,357 % fällig am 28.01.2042	£	1.278		1.484	0,03
Lehman XS Trust					
5,650 % fällig am 25.08.2037	$	1.584		1.325	0,03
London Wall Mortgage Capital PLC					
5,452 % fällig am 15.05.2051	£	20.779		24.059	0,57
Miravet SARL					
4,265 % fällig am 26.05.2065	€	2.839		2.795	0,07
Mortgage Equity Conversion Asset Trust					
5,790 % fällig am 25.05.2042	$	106		91	0,00
New Residential Mortgage Loan Trust					
4,500 % fällig am 25.05.2058		389		341	0,01

BESCHREIBUNG		PARI (000S)		MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
Polaris PLC					
5,631 % fällig am 23.12.2058	£	1.068	€	1.239	0,03
6,141 % fällig am 23.05.2059		10.070		11.758	0,28
Precise Mortgage Funding PLC					
6,065 % fällig am 12.12.2055		2.347		2.743	0,06
Residential Accredit Loans, Inc. Trust					
4,398 % fällig am 25.10.2037	$	309		251	0,01
6,500 % fällig am 25.07.2036		88		63	0,00
Stanlington PLC					
5,815 % fällig am 12.06.2045	£	20.066		23.287	0,55
Stratton BTL Mortgage Funding PLC					
5,221 % fällig am 20.01.2054		8.549		9.911	0,23
Stratton Mortgage Funding PLC					
5,792 % fällig am 25.09.2051		3.037		3.531	0,08
Towd Point Mortgage Funding PLC					
5,635 % fällig am 20.10.2051		1.704		1.989	0,05
5,841 % fällig am 20.07.2045		6.264		7.303	0,17
6,216 % fällig am 20.02.2045		388		452	0,01
6,546 % fällig am 20.02.2054		506		589	0,01
Tower Bridge Funding PLC					
5,399 % fällig am 21.07.2064		488		568	0,01
5,527 % fällig am 20.11.2063		6.079		7.047	0,17
5,991 % fällig am 20.10.2064		26.200		30.703	0,72
Tudor Rose Mortgages					
5,509 % fällig am 20.06.2048		1.830		2.120	0,05
WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust					
3,753 % fällig am 25.02.2037 ^	$	34		29	0,00
5,024 % fällig am 25.08.2046		7.957		6.012	0,14
5,950 % fällig am 25.06.2044		289		244	0,01
				171.393	4,02
FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE					
Accredited Mortgage Loan Trust					
6,020 % fällig am 25.09.2035		2.800		2.347	0,06
Accunia European CLO DAC					
4,107 % fällig am 15.10.2030	€	561		557	0,01
4,127 % fällig am 15.07.2030		994		981	0,02
ACE Securities Corp. Home Equity Loan Trust					
5,450 % fällig am 25.04.2036	$	236		209	0,01
5,450 % fällig am 25.07.2036		234		80	0,00
Adagio CLO DAC					
3,897 % fällig am 15.10.2031	€	2.500		2.452	0,06
Aqueduct European CLO DAC					
3,840 % fällig am 20.07.2030		2.995		2.957	0,07
Ares European CLO DAC					
3,837 % fällig am 15.10.2030		2.981		2.925	0,07
3,957 % fällig am 15.10.2031		6.400		6.290	0,15
Armada Euro CLO DAC					
3,897 % fällig am 15.07.2031		6.297		6.161	0,15
Aurium CLO DAC					
3,847 % fällig am 16.04.2030		595		584	0,01
Avoca CLO DAC					
3,867 % fällig am 15.07.2030		1.453		1.429	0,03
3,997 % fällig am 15.10.2032		1.900		1.857	0,04
Bain Capital Euro CLO DAC					
3,940 % fällig am 20.01.2032		2.883		2.820	0,07
Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust					
6,200 % fällig am 25.08.2037	$	163		125	0,00
Black Diamond CLO DAC					
4,060 % fällig am 20.01.2032	€	1.673		1.650	0,04
4,303 % fällig am 15.05.2032		3.000		2.935	0,07
Blackrock European CLO DAC					
3,797 % fällig am 15.10.2031		5.000		4.885	0,12
BlueMountain Fuji EUR CLO DAC					
1,050 % fällig am 15.01.2031		398		367	0,01
3,827 % fällig am 15.07.2030		1.372		1.348	0,03
3,897 % fällig am 15.01.2031		3.082		3.020	0,07
4,087 % fällig am 15.01.2033		1.000		975	0,02
BNPP AM Euro CLO DAC					
3,777 % fällig am 15.04.2031		300		293	0,01
3,827 % fällig am 15.10.2031		246		241	0,01
Cairn CLO DAC					
3,842 % fällig am 30.04.2031		3.647		3.574	0,08
3,912 % fällig am 31.01.2030		597		587	0,01
3,957 % fällig am 15.10.2031		3.700		3.627	0,09
4,051 % fällig am 25.07.2029		714		713	0,02
4,212 % fällig am 20.10.2028		16		16	0,00

BESCHREIBUNG		PARI (000S)		MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
Carlyle Euro CLO DAC					
3,877 % fällig am 15.01.2031	€	4.978	€	4.873	0,11
3,953 % fällig am 15.08.2030		181		177	0,00
4,213 % fällig am 15.08.2032		1.450		1.417	0,03
Carlyle Global Market Strategies Euro CLO DAC					
4,137 % fällig am 16.01.2033		1.000		969	0,02
Carlyle Global Market Strategies Euro CLO Ltd.					
4,073 % fällig am 15.11.2031		3.650		3.581	0,08
Carrington Mortgage Loan Trust					
5,750 % fällig am 25.01.2036	$	9.750		8.529	0,20
CIT Mortgage Loan Trust					
6,650 % fällig am 25.10.2037		400		357	0,01
Citigroup Mortgage Loan Trust					
4,165 % fällig am 25.10.2037		764		604	0,01
7,250 % fällig am 25.05.2036		108		53	0,00
Contego CLO BV					
3,947 % fällig am 15.10.2030	€	999		983	0,02
Contego CLO DAC					
3,851 % fällig am 23.01.2030		2.294		2.248	0,05
Countrywide Asset-Backed Certificates Trust					
5,290 % fällig am 25.08.2037	$	1.038		939	0,02
5,370 % fällig am 25.09.2037 ^		55		50	0,00
5,400 % fällig am 25.02.2036		107		92	0,00
CVC Cordatus Loan Fund DAC					
3,827 % fällig am 15.10.2031	€	8.700		8.537	0,20
3,855 % fällig am 21.07.2030		4.631		4.555	0,11
4,156 % fällig am 15.09.2031		2.699		2.642	0,06
Dryden Euro CLO DAC					
3,837 % fällig am 15.04.2033		5.000		4.891	0,12
4,183 % fällig am 15.05.2034		5.900		5.774	0,14
Ellington Loan Acquisition Trust					
6,250 % fällig am 25.05.2037	$	91		80	0,00
Euro-Galaxy CLO DAC					
3,831 % fällig am 24.04.2034	€	3.700		3.603	0,09
First Franklin Mortgage Loan Trust					
5,855 % fällig am 25.11.2036	$	6.816		5.965	0,14
Fremont Home Loan Trust					
5,290 % fällig am 25.01.2037		390		182	0,00
GoldenTree Loan Management EUR CLO DAC					
4,100 % fällig am 20.01.2032	€	900		878	0,02
Griffith Park CLO DAC					
4,103 % fällig am 21.11.2031		16.100		15.796	0,37
GSAA Home Equity Trust					
5,250 % fällig am 25.12.2046	$	954		439	0,01
5,985 % fällig am 25.06.2036		1.148		291	0,01
Harvest CLO DAC					
1,040 % fällig am 15.07.2031	€	500		456	0,01
3,817 % fällig am 15.10.2031		4.400		4.296	0,10
3,880 % fällig am 20.10.2031		7.400		7.249	0,17
3,937 % fällig am 15.07.2031		4.000		3.904	0,09
4,027 % fällig am 15.01.2032		19.900		19.473	0,46
4,250 % fällig am 26.06.2030		3.545		3.474	0,08
Hill FL BV					
4,050 % fällig am 18.05.2030		11.259		11.296	0,27
Invesco Euro CLO DAC					
3,827 % fällig am 15.07.2031		500		488	0,01
JPMorgan Mortgage Acquisition Trust					
5,360 % fällig am 25.10.2036	$	87		79	0,00
5,450 % fällig am 25.03.2037		13.800		11.362	0,27
Jubilee CLO DAC					
3,777 % fällig am 15.04.2030	€	1.400		1.368	0,03
3,787 % fällig am 15.04.2030		3.800		3.724	0,09
3,827 % fällig am 15.04.2031		4.300		4.194	0,10
4,326 % fällig am 15.12.2029		246		243	0,01
Koromo Italy SRL					
4,213 % fällig am 26.02.2035		2.368		2.374	0,06
Laurelin DAC					
3,920 % fällig am 20.10.2031		4.700		4.615	0,11
Madison Park Euro Funding DAC					
3,977 % fällig am 15.07.2032		3.200		3.121	0,07
Man GLG Euro CLO DAC					
3,857 % fällig am 15.10.2030		1.685		1.655	0,04
4,047 % fällig am 15.01.2030		440		434	0,01
4,216 % fällig am 15.12.2031		4.396		4.316	0,10
Marlay Park CLO DAC					
3,917 % fällig am 15.10.2030		929		916	0,02

BESCHREIBUNG		PARI (000S)		MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
MASTR Asset-Backed Securities Trust					
5,930 % fällig am 25.02.2034	$	1.186	€	1.047	0,03
Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust					
5,400 % fällig am 25.07.2036		131		104	0,00
5,450 % fällig am 25.07.2036		259		91	0,00
Morgan Stanley Home Equity Loan Trust					
5,250 % fällig am 25.04.2037		102		49	0,00
NovaStar Mortgage Funding Trust					
5,350 % fällig am 25.09.2037		127		112	0,00
Oak Hill European Credit Partners DAC					
3,930 % fällig am 20.01.2032	€	835		816	0,02
3,940 % fällig am 20.10.2031		8.200		7.986	0,19
Oak Hill European Credit Partners Ltd.					
4,100 % fällig am 22.07.2030		2.342		2.332	0,06
OCP Euro CLO DAC					
4,091 % fällig am 22.09.2034		5.200		5.065	0,12
4,713 % fällig am 20.01.2033		20.900		20.868	0,49
Option One Mortgage Loan Trust					
5,290 % fällig am 25.03.2037	$	170		140	0,00
5,370 % fällig am 25.04.2037		490		320	0,01
5,370 % fällig am 25.05.2037		357		193	0,01
5,930 % fällig am 25.11.2034		113		99	0,00
Palmer Square European Loan Funding DAC					
3,897 % fällig am 15.10.2031	€	3.940		3.862	0,09
3,907 % fällig am 15.07.2031		2.976		2.906	0,07
3,957 % fällig am 15.04.2031		1.626		1.597	0,04
Palmerston Park CLO DAC					
3,825 % fällig am 18.04.2030		795		785	0,02
PBD Germany Auto Lease Master S.A., Compartment					
4,139 % fällig am 26.11.2030		8.772		8.788	0,21
Renaissance Home Equity Loan Trust					
5,285 % fällig am 25.01.2037	$	227		72	0,00
5,545 % fällig am 25.01.2037		334		112	0,00
Residential Asset Securities Corp. Trust					
5,830 % fällig am 25.05.2037		1.137		1.016	0,02
Saxon Asset Securities Trust					
5,585 % fällig am 25.09.2036		7.500		6.302	0,15
Segovia European CLO DAC					
4,080 % fällig am 20.07.2032	€	4.100		3.995	0,09
Silver Arrow Merfina SRL					
4,055 % fällig am 20.07.2033		12.502		12.526	0,29
Silver Arrow S.A.					
4,028 % fällig am 15.09.2027		22		224	0,01
Sound Point Euro CLO Funding DAC					
4,777 % fällig am 15.01.2032		12.298		12.235	0,29
Soundview Home Loan Trust					
5,300 % fällig am 25.03.2037	$	58		49	0,00
5,320 % fällig am 25.07.2037		759		571	0,01
5,320 % fällig am 25.08.2037		835		648	0,02
5,650 % fällig am 25.10.2036		158		135	0,00
6,050 % fällig am 25.10.2037		1.922		1.390	0,03
Tikehau CLO DAC					
4,144 % fällig am 04.08.2034	€	2.300		2.247	0,05
Toro European CLO DAC					
3,995 % fällig am 12.01.2032		1.700		1.667	0,04
4,133 % fällig am 15.02.2034		5.300		5.158	0,12
				329.054	7,73
STAATSEMISSIONEN					
Bpifrance Financement S.A.					
4,000 % fällig am 30.01.2026	£	2.400		2.662	0,06
Cyprus Government International Bond					
3,750 % fällig am 26.07.2023	€	1.400		1.402	0,03
Development Bank of Japan, Inc.					
4,500 % fällig am 06.06.2025	£	1.100		1.243	0,03
Export Development Canada					
4,000 % fällig am 19.02.2026		12.500		13.949	0,33
France Government International Bond					
4,250 % fällig am 25.10.2023	€	117.260		117.517	2,76
Romania Government International Bond					
5,000 % fällig am 27.09.2026		26.000		26.125	0,61
Serbia Government International Bond					
6,250 % fällig am 26.05.2028	$	300		274	0,01
Stockholms Lans Landsting					
0,750 % fällig am 26.02.2025	€	7.000		6.645	0,16
				169.817	3,99

BESCHREIBUNG	AKTIEN	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
STAMMAKTIEN			
LUXUSGÜTER			
BYD Co. Ltd. 'H'	542.554	€ 15.944	0,38
Luminar Technologies, Inc. (a)	679.800	4.287	0,10
Panasonic Holdings Corp.	2.947.740	33.075	0,78
QuantumScape Corp. (a)	78.600	576	0,01
		53.882	1,27
ENERGIE			
Neste Oyj	342.000	12.067	0,28
SK Innovation Co. Ltd. (a)	88.449	9.829	0,23
		21.896	0,51
FINANZWERTE			
Bank of America Corp.	475.000	12.491	0,29
Citigroup, Inc.	302.700	12.774	0,30
JPMorgan Chase & Co.	103.200	13.757	0,32
Wells Fargo & Co.	352.600	13.794	0,33
		52.816	1,24
INDUSTRIEWERTE			
ABB Ltd.	463.440	16.719	0,39
Aker Carbon Capture ASA (a)	6.124.174	7.381	0,17
Ballard Power Systems, Inc. (a)	208.500	838	0,02
Contemporary Amperex Technology Co. Ltd. 'A'	142.660	4.131	0,10
Daifuku Co. Ltd.	623.700	11.755	0,28
FuelCell Energy, Inc. (a)	467.500	926	0,02
Generac Holdings, Inc. (a)	37.600	5.140	0,12
GXO Logistics, Inc. (a)	373.500	21.506	0,51
Hitachi Zosen Corp.	3.432.700	20.785	0,49
ITM Power PLC (a)	1.371.816	1.158	0,03
NEL ASA (a)	11.600.925	12.517	0,29
Plug Power, Inc. (a)	429.200	4.087	0,10
PowerCell Sweden AB (a)	133.581	953	0,02
Schneider Electric SE	189.600	31.567	0,74
Sensata Technologies Holding PLC	456.276	18.816	0,44
Siemens Energy AG (a)	1.735.400	28.120	0,66
Titan Wind Energy Suzhou Co. Ltd. 'A'	2.304.747	4.436	0,10
Valmet Oyj	896.500	22.870	0,54
Vestas Wind Systems A/S	1.579.000	38.472	0,90
Xinjiang Goldwind Science & Technology Co. Ltd. 'H'	8.559.400	5.392	0,13
		257.569	6,05
INFORMATIONSTECHNOLOGIE			
ams-OSRAM AG (a)	399.720	2.642	0,06
Canadian Solar, Inc. (a)	196.700	6.976	0,16
Chipbond Technology Corp.	1.163.908	2.165	0,05
Cirrus Logic, Inc. (a)	127.400	9.460	0,22
Daqo New Energy Corp. (a)	164.000	5.968	0,14
Delta Electronics, Inc.	859.112	8.727	0,21
Elan Microelectronics Corp.	1.059.109	3.175	0,07
Enphase Energy, Inc. (a)	177.800	27.294	0,64
First Solar, Inc. (a)	247.600	43.141V	1,01
Flat Glass Group Co. Ltd. 'H'	3.048.000	9.578	0,22
Flex Ltd. (a)	835.700	21.172	0,50
Globalwafers Co. Ltd.	371.309	5.462	0,13
GoerTek, Inc. 'A'	1.448.705	3.254	0,08
Hamamatsu Photonics KK	124.800	5.607	0,13

BESCHREIBUNG	AKTIEN	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
LONGi Green Energy Technology Co. Ltd. 'A'	2.481.197	€ 8.998	0,21
MediaTek, Inc.	193.008	3.916	0,09
Nanya Technology Corp.	1.762.907	3.684	0,09
Novatek Microelectronics Corp.	350.204	4.407	0,10
NXP Semiconductors NV	85.100	15.965	0,38
Ouster, Inc. (a)	25.215	114	0,00
Power Integrations, Inc.	56.500	4.903	0,12
Realtek Semiconductor Corp.	411.407	4.702	0,11
Samsung Electronics Co. Ltd.	301.100	15.197	0,36
Samsung SDI Co. Ltd.	20.071	9.394	0,22
SMA Solar Technology AG (a)	158.978	17.820	0,42
SolarEdge Technologies, Inc. (a)	117.100	28.878	0,68
Synopsys, Inc. (a)	18.000	7.184	0,17
Taiwan Semiconductor Manufacturing Co. Ltd.	1.088.809	18.436	0,43
Trimble, Inc. (a)	270.100	13.106	0,31
Unimicron Technology Corp.	1.026.100	5.348	0,13
United Microelectronics Corp.	7.498.819	10.799	0,25
Xinyi Solar Holdings Ltd.	11.726.500	12.478	0,29
Zebra Technologies Corp. 'A' (a)	65.800	17.842	0,42
		357.792	8,40
BAUSTOFFE			
Calix Ltd. (a)	1.188.128	3.043	0,07
Canfor Corp. (a)	1.155.200	19.029	0,45
Hanwha Solutions Corp.	338.017	9.991	0,23
Holmen AB 'B'	512.100	16.845	0,40
LG Chem Ltd.	40.600	18.944	0,45
Stora Enso Oyj 'R'	1.392.400	14.805	0,35
thyssenkrupp AG	584.900	4.198	0,10
Umicore S.A.	156.400	4.007	0,09
UPM-Kymmene Oyj	614.300	16.774	0,39
Wacker Chemie AG	36.600	4.608	0,11
West Fraser Timber Co. Ltd.	291.400	22.972	0,54
		135.216	3,18
VERSORGUNGSUNTERNEHMEN			
Xinyi Energy Holdings Ltd.	20.560.479	6.173	0,14
Summe Stammaktien		885.344	20,79
VORZUGSWERTPAPIERE			
Hanwha Solutions Corp. 0,000 %	4.662	102	0,00
REAL ESTATE INVESTMENT TRUSTS			
Weyerhaeuser Co.	662.000	20.333	0,48

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
KURZFRISTIGE INSTRUMENTE			
ÖSTERREICHISCHE SCHATZTITEL			
2,971 % fällig am 27.07.2023 (b)(c)	€ 8.250	8.234	0,20
2,996 % fällig am 27.07.2023 (b)(c)	8.250	8.233	0,19
		16.467	0,39
SCHATZTITEL DES EUROPÄISCHEN STABILITÄTSMECHANISMUS			
3,328 % fällig am 23.11.2023 (b)(c)	€ 32.100	€ 31.652	0,75
3,337 % fällig am 07.09.2023 (b)(c)	550	547	0,01
		32.199	0,76
SCHATZTITEL DER EUROPÄISCHEN UNION			
3,105 % fällig am 08.09.2023 (b)(c)	15.000	14.907	0,35
3,163 % fällig am 04.08.2023 (b)(c)	6.250	6.232	0,14
3,172 % fällig am 04.08.2023 (b)(c)	300	299	0,01
3,173 % fällig am 04.08.2023 (b)(c)	550	548	0,01
3,179 % fällig am 04.08.2023 (b)(c)	450	449	0,01
3,214 % fällig am 07.07.2023 (b)(c)	5.000	4.999	0,12
3,326 % fällig am 08.09.2023 (b)(c)	350	348	0,01
3,387 % fällig am 08.09.2023 (b)(c)	2.600	2.584	0,06
		30.366	0,71
FRANCE TREASURY BILLS			
2,902 % fällig am 05.07.2023 (b)(c)	2.550	2.550	0,06
3,127 % fällig am 02.08.2023 (b)(c)	3.250	3.242	0,08
3,135 % fällig am 02.08.2023 (b)(c)	900	898	0,02
3,146 % fällig am 02.08.2023 (b)(c)	700	698	0,02
3,149 % fällig am 02.08.2023 (b)(c)	700	698	0,02
3,349 % fällig am 30.08.2023 (b)(c)	650	647	0,01
3,358 % fällig am 23.08.2023 (b)(c)	6.450	6.420	0,15
3,370 % fällig am 13.09.2023 (b)(c)	650	646	0,02
3,387 % fällig am 30.08.2023 (b)(c)	400	398	0,01
3,402 % fällig am 30.08.2023 (b)(c)	40.000	39.790	0,93
3,404 % fällig am 30.08.2023 (b)(c)	12.110	12.047	0,28
3,428 % fällig am 13.09.2023 (b)(c)	8.060	8.007	0,19
3,431 % fällig am 13.09.2023 (b)(c)	69.170	68.713	1,61
3,431 % fällig am 04.10.2023 (b)(c)	9.200	9.121	0,21
3,432 % fällig am 13.09.2023 (b)(c)	33.730	33.507	0,79
3,434 % fällig am 13.09.2023 (b)(c)	6.450	6.407	0,15
3,435 % fällig am 13.09.2023 (b)(c)	49.300	48.975	1,15
3,440 % fällig am 13.09.2023 (b)(c)	250	248	0,01
3,444 % fällig am 13.09.2023 (b)(c)	12.900	12.815	0,30
3,445 % fällig am 13.09.2023 (b)(c)	6.450	6.407	0,15
		262.234	6,16
GERMANY TREASURY BILLS			
3,143 % fällig am 19.07.2023 (b)(c)	800	799	0,02
3,194 % fällig am 19.07.2023 (b)(c)	29.100	29.062	0,68
		29.861	0,70
JAPAN TREASURY BILLS			
(0,206) % fällig am 18.07.2023 (b)(c)	¥ 63.000	400	0,01
(0,199) % fällig am 11.09.2023 (b)(c)	10.988.000	69.699	1,64

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
(0,188) % fällig am 18.07.2023 (b)(c)	¥ 30.000	€ 190	0,00
(0,187) % fällig am 10.07.2023 (b)(c)	9.732.000	61.718	1,45
(0,179) % fällig am 11.09.2023 (b)(c)	2.452.000	15.553	0,36
(0,168) % fällig am 10.07.2023 (b)(c)	3.958.000	25.101	0,59
(0,152) % fällig am 25.09.2023 (b)(c)	11.999.000	76.116	1,79
(0,132) % fällig am 25.09.2023 (b)(c)	3.411.000	21.638	0,51
		270.415	6,35
Summe kurzfristige Instrumente		641.542	15,07
Summe Übertragbare Wertpapiere		**€ 4.246.875**	**99,74**

BESCHREIBUNG	AKTIEN	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
INVESTMENTFONDS			
ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN			
PIMCO Funds: Global Investors Series plc - Income Fund (f)	6.473.317	€ 102.529	2,41
PIMCO Funds: Global Investors Series plc - PIMCO Capital Securities Fund (f)	2.942.298	28.209	0,66
PIMCO Funds: Global Investors Series plc - PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund (f)	3.189.591	32.276	0,76
		163.014	3,83

BESCHREIBUNG	AKTIEN	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
BÖRSENGEHANDELTE FONDS			
PIMCO ETFs plc - PIMCO Euro Short Maturity UCITS ETF (f)	2.485.300	€ 241.004	5,66
PIMCO ETFs plc - PIMCO Euro Short-Term High Yield Corporate Bond Index UCITS ETF (f)	1.532.400	15.843	0,37
		256.847	6,03
Summe Investmentfonds		**€ 419.861**	**9,86**

PENSIONSGESCHÄFTE

Kontrahent	Kredit-zins	Abrechnungs-datum	Fälligkeits-datum	Kapital-betrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensions-geschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensions-geschäft[1]	% des Nettovermögens
BPS	3,100 %	30.06.2023	03.07.2023	€ 73.200	Societe Nationale SNCF S.A. 4,150 % fällig am 18.01.2042	€ (73.831)	€ 73.200	€ 73.219	1,72
FICC	2,400	30.06.2023	03.07.2023	$ 17.637	U.S. Treasury Notes 4,625 % fällig am 30.06.2025	(16.489)	16.166	16.166	0,38
IND	3,150	30.06.2023	03.07.2023	€ 28.000	France Government International Bond 1,500 % - 5,500 % fällig am 25.10.2023 - 25.05.2050	(28.465)	28.000	28.007	0,66
	3,150	30.06.2023	03.07.2023	212.200	Agence Francaise de Developpement EPIC 0,000 % - 3,125 % fällig am 04.01.2024 - 31.10.2034	(5.350)	212.200	212.256	4,98
					Agence France Locale 3,000 % fällig am 20.03.2030	(692)			
					BNG Bank NV 0,050 % - 1,500 % fällig am 20.11.2029 - 15.07.2039	(2.220)			
					Bpifrance 0,250 % fällig am 04.06.2031	(798)			
					Caisse d'Amortissement de la Dette Sociale 2,375 % - 4,000 % fällig am 25.01.2024 - 15.12.2025	(1.508)			
					Entwicklungsbank des Europarates 0,000 % - 1,000 % fällig am 09.04.2027 - 13.04.2029	(2.300)			
					Europäische Finanzstabilisierungsfazilität 0,000 % - 2,750 % fällig am 17.07.2023 - 10.07.2048	(20.475)			
					Europäische Investitionsbank 0,000 % - 3,625 % fällig am 15.07.2024 - 16.10.2048	(29.499)			
					Europäischer Stabilitätsmechanismus 0,000 % - 1,625 % fällig am 31.07.2023 - 17.11.2036	(5.212)			
					Europäische Union 0,000 % - 3,375 % fällig am 04.11.2025 - 04.10.2052	(30.747)			
					Schatztitel der Europäischen Union 0,000 % fällig am 08.09.2023 - 10.11.2023	(20.536)			
					Kreditanstalt für Wiederaufbau 0,000 % - 3,125 % fällig am 02.04.2024 - 15.06.2037	(32.466)			
					La Poste S.A. 2,625 % - 3,125 % fällig am 14.09.2028 - 14.03.2033	(1.143)			
					Land Berlin 0,010 % fällig am 26.10.2028	(3.312)			
					Landwirtschaftliche Rentenbank 0,500 % fällig am 06.03.2025	(1.237)			
					Luxembourg Government International Bond 0,000 % - 3,250 % fällig am 19.03.2028 - 02.03.2043	(50.663)			
					Nederlandse Waterschapsbank NV 0,000 % fällig am 16.02.2037	(1.634)			
					NRW Bank 0,490 %, fällig am 23.02.2026	(600)			
					SFIL S.A. 1,500 %, fällig am 05.03.2032	(174)			
					Niedersachsen 2,875 % fällig am 18.04.2028	(197)			
					Nordrhein-Westfalen 0,000 % - 0,625 % fällig am 17.11.2023 - 26.11.2029	(2.043)			
					UNEDIC 0,000 % - 1,250 % fällig am 17.02.2025 - 25.05.2036	(4.648)			
Summe Pensionsgeschäfte						**€ (336.239)**	**€ 329.566**	**€ 329.648**	**7,74**

(1) Umfasst aufgelaufene Zinsen.

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

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

FUTURES

Beschreibung	Art	Ablauf-monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Australia Government 10-Year Bond September Futures	Long	09.2023	9.359	€ (4.643)	(0,11)
Canada Government 10-Year Bond September Futures	Long	09.2023	1.682	(2.074)	(0,05)
E-mini S&P 500 Index September Futures	Long	09.2023	3.482	9.485	0,22
Euro STOXX 50 September Futures	Short	09.2023	3.258	(2.145)	(0,05)
Euro-BTP Italy Government Bond September Futures	Short	09.2023	1.453	(777)	(0,02)
FTSE 100 Index September Futures	Long	09.2023	470	(334)	(0,01)
Nikkei 225 Yen-Denominated September Futures	Long	09.2023	628	2.008	0,05
U.S. Treasury 10-Year Note September Futures	Long	09.2023	4.758	(8.676)	(0,20)
U.S. Treasury 10-Year Ultra September Futures	Short	09.2023	1.707	1.773	0,04
U.S. Treasury 30-Year Bond September Futures	Long	09.2023	1.724	2.072	0,05
				€ (3.311)	(0,08)
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate				**€ (3.311)**	**(0,08)**

ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)

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

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMMISSIONEN - SCHUTZVERKAUF[1]

Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag[2]	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
AT&T, Inc.	1,000 %	20.06.2026	$ 500	€ (4)	0,00
Verizon Communications, Inc.	1,000	20.12.2027	100	2	0,00
Verizon Communications, Inc.	1,000	20.06.2028	1.200	4	0,00
				€ 2	0,00

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES - SCHUTZVERKAUF[1]

Index/Tranchen	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag[2]	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
CDX.IG-39 5-Year Index	1,000 %	20.12.2027	$ 102.800	€ 262	0,01
CDX.IG-40 5-Year Index	1,000	20.06.2028	1.161.300	7.673	0,18
iTraxx Crossover 39 5-Year Index	5,000	20.06.2028	€ 15.100	474	0,01
				€ 8.409	0,20

ZINSSWAPS

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,750 %	21.06.2053	110.400	€ (879)	(0,02)
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,000	21.06.2030	324.500	3.520	0,08
Erhalt[3]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,250	20.12.2053	30.500	(307)	(0,01)
Erhalt[3]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,500	20.12.2030	96.700	(132)	0,00
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	1,250	16.06.2031	82.272	(6.476)	(0,15)
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	1,500	17.06.2030	150.600	(18.046)	(0,42)
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	1,900	18.12.2029	181	(21)	0,00
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	2,500	19.06.2029	123.500	(13.870)	(0,33)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,547	09.03.2033	17.200	(343)	(0,01)
					€ (36.554)	(0,86)
Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate					**€ (28.143)**	**(0,66)**

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

(2) Der maximal mögliche Betrag, den der Fonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

(3) Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft.

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

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

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMMISSIONEN - SCHUTZKAUF[1]

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu bezahlender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag[2]	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Markt-wert	% des Nettovermögens
BPS	China Government International Bond	(1,000) %	20.12.2023	$ 17.130	€ (303)	€ 240	€ (63)	0,00
BRC	China Government International Bond	(1,000)	20.12.2023	16.800	(309)	247	(62)	0,00
					€ (612)	€ 487	€ (125)	0,00

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

(2) Der maximal mögliche Betrag, den der Fonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

TOTAL RETURN SWAPS AUF INDIZES

Kontrahent	Zahlung/ Erhalt	Wertpapier	Anzahl der Anteile oder Einheiten	Variabler Zinssatz	Nenn-betrag	Fälligkeits-datum	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Markt-wert	% des Nettovermögens
BPS	Zahlung	IXITR Index	35.821	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	$ 136.046	21.02.2024	€ 0	€ (2.830)	€ (2.830)	(0,07)

DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung		Zu erhaltende Währung		Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2023	CHF	5.230	€	5.404	€ 46	€ 0	€ 46	0,00
	07.2023	DKK	79.538		10.682	0	0	0	0,00
	07.2023	€	4.505	$	4.935	19	0	19	0,00
	07.2023	£	1.202	€	1.403	3	0	3	0,00
	07.2023	MXN	1.514.828	$	82.283	0	(5.300)	(5.300)	(0,12)
	07.2023	$	50.244	CLP	40.670.241	419	0	419	0,01
	07.2023		26.619	€	24.769	370	0	370	0,01
	08.2023		77	CNY	532	0	(4)	(4)	0,00
	09.2023	HKD	664.812	$	85.081	91	0	91	0,00
	09.2023	KRW	29.603.067		23.365	734	0	734	0,02
	09.2023	TWD	3.453.846		113.775	2.415	0	2.415	0,06
	09.2023	$	9.264	INR	761.394	0	(9)	(9)	0,00
BPS	07.2023	AUD	31.480	€	19.539	339	(7)	332	0,01
	07.2023	€	17.811	AUD	29.332	84	0	84	0,00
	07.2023		1.501.445	$	1.644.716	6.549	(463)	6.086	0,14
	07.2023	¥	4.029.015	€	26.873	1.320	0	1.320	0,03
	07.2023	$	553.613		514.883	7.447	0	7.447	0,17
	08.2023	AUD	27.143		16.475	0	(76)	(76)	0,00
	08.2023	TWD	1.728.769	$	56.623	1.011	0	1.011	0,02
	08.2023	$	91	CNY	625	0	(5)	(5)	0,00
	08.2023		1.553.626	€	1.415.941	0	(6.150)	(6.150)	(0,14)
	08.2023		5.624	TWD	172.130	0	(88)	(88)	0,00
BRC	07.2023	€	1.364	CAD	1.960	0	(7)	(7)	0,00
	07.2023		38.572	DKK	287.210	2	0	2	0,00
	07.2023		8.435	£	7.236	5	(8)	(3)	0,00
	07.2023	£	49.719	€	57.555	0	(381)	(381)	(0,01)
	07.2023	NOK	100.791		8.478	0	(145)	(145)	0,00
	07.2023	SEK	112.037		9.635	127	0	127	0,00
	08.2023	CNH	28	$	4	0	0	0	0,00
	08.2023	DKK	287.132	€	38.572	0	(3)	(3)	0,00
	08.2023	$	37.911	COP	161.511.195	265	0	265	0,01
	09.2023	HKD	86.463	$	11.067	13	0	13	0,00
	09.2023	ILS	190.231		53.181	1.620	0	1.620	0,04
CBK	07.2023	AUD	15.915	€	9.897	187	0	187	0,00
	07.2023	€	4.395	AUD	7.227	14	0	14	0,00
	07.2023		992	£	854	3	0	3	0,00
	07.2023		189.631	$	204.571	0	(2.124)	(2.124)	(0,05)
	07.2023	MXN	304		18	0	0	0	0,00
	08.2023	TWD	1.799.846		58.961	1.061	0	1.061	0,02
	08.2023	$	50	CNH	347	0	(2)	(2)	0,00
	09.2023		226	KRW	290.191	0	(4)	(4)	0,00
	10.2023		12.335	CLP	10.074.895	66	0	66	0,00
CLY	08.2023	£	18	€	21	0	0	0	0,00
DUB	07.2023	NOK	13.896		1.156	0	(33)	(33)	0,00
GLM	07.2023	$	43.705	COP	184.476.458	320	0	320	0,01
	07.2023		2.394	MXN	41.984	45	0	45	0,00
	08.2023		155	ZAR	2.877	0	(3)	(3)	0,00
	09.2023		73.259	BRL	370.780	2.497	0	2.497	0,06
JPM	07.2023	CHF	420	€	433	3	0	3	0,00
	07.2023	DKK	266.393		35.771	0	(7)	(7)	0,00

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung		Zu erhaltende Währung		Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
	07.2023	€	4.964	DKK	36.967	€ 1	€ 0	€ 1	0,00
	07.2023		8.520	¥	1.267.600	0	(480)	(480)	(0,01)
	07.2023		1.032	SEK	11.985	0	(14)	(14)	0,00
	07.2023		240.155	$	259.037	60	(2.784)	(2.724)	(0,06)
	07.2023	£	2.555	€	2.960	0	(17)	(17)	0,00
	07.2023	¥	632.439		4.247	236	0	236	0,01
	07.2023	SEK	150.158		13.009	267	0	267	0,01
	08.2023	DKK	36.957		4.964	0	(1)	(1)	0,00
	08.2023	$	96	CNY	660	0	(5)	(5)	0,00
	08.2023		79.190	€	72.424	0	(62)	(62)	0,00
	08.2023		146.440	HUF	50.867.136	667	(272)	395	0,01
	09.2023	ILS	182.549	$	51.390	1.881	0	1.881	0,04
	09.2023	$	72.247	INR	5.954.234	112	0	112	0,00
	09.2023		81.734	PEN	300.945	715	0	715	0,02
	10.2023	MXN	926.676	$	52.778	0	(181)	(181)	0,00
MBC	07.2023	CAD	166.122	€	114.646	59	(483)	(424)	(0,01)
	07.2023	€	2.917	DKK	21.724	1	0	1	0,00
	07.2023		164.832	£	142.326	1.015	0	1.015	0,02
	07.2023		76.829	¥	12.108.044	0	(37)	(37)	0,00
	07.2023		158.565	$	173.387	360	0	360	0,01
	07.2023	£	168.418	€	194.358	0	(1.893)	(1.893)	(0,05)
	07.2023	¥	14.680.286		98.295	5.187	0	5.187	0,12
	07.2023	SGD	18	$	14	0	0	0	0,00
	07.2023	$	51.135	CLP	42.088.907	1.064	0	1.064	0,02
	08.2023	DKK	21.718	€	2.917	0	(1)	(1)	0,00
	08.2023	£	142.494		164.832	0	(1.004)	(1.004)	(0,02)
	08.2023	¥	12.073.884		76.829	20	0	20	0,00
	08.2023	$	41	CNH	290	0	(1)	(1)	0,00
	09.2023	¥	15.410.000	€	99.459	877	0	877	0,02
	09.2023	KRW	54.875.510	$	43.029	1.102	0	1.102	0,03
MYI	07.2023	AUD	10	€	6	0	0	0	0,00
	07.2023	CHF	27.918		28.759	155	0	155	0,00
	07.2023	€	2.949	CAD	4.261	7	(5)	2	0,00
	07.2023		124	CHF	121	0	0	0	0,00
	07.2023		1.920	£	1.658	12	0	12	0,00
	07.2023		41.929	¥	6.271.800	0	(2.152)	(2.152)	(0,05)
	07.2023		446	$	486	0	0	0	0,00
	07.2023	£	55	€	64	0	0	0	0,00
	07.2023	¥	415.400		2.775	140	0	140	0,00
	07.2023	$	49.290		46.119	940	0	940	0,02
	08.2023	TWD	1.891.449	$	62.367	1.486	0	1.486	0,03
	09.2023	CLP	2.037.963		2.542	23	0	23	0,00
	09.2023	KRW	61.671.203		48.191	1.085	0	1.085	0,02
	09.2023	$	6.308	INR	520.340	14	0	14	0,00
RBC	07.2023	CAD	4.692	€	3.273	23	0	23	0,00
	07.2023	$	202	MXN	3.878	22	0	22	0,00
	08.2023		1.156		20.029	2	0	2	0,00
RYL	07.2023	€	2.224	CAD	3.222	8	0	8	0,00
SCX	07.2023		1.040	AUD	1.715	6	0	6	0,00
	07.2023		20.479	NOK	240.775	120	0	120	0,00
	07.2023	NOK	202.909	€	17.174	0	(186)	(186)	0,00
	07.2023	$	23.965	CLP	19.294.070	7	0	7	0,00
	08.2023	NOK	240.874	€	20.479	0	(120)	(120)	0,00
	08.2023	TWD	24.582	$	805	14	0	14	0,00
	09.2023		2.886.012		94.661	1.644	0	1.644	0,04
	09.2023	$	45.215	INR	3.723.883	42	0	42	0,00
SOG	07.2023		1.622.785	€	1.508.530	21.102	0	21.102	0,49
	07.2023		1.291	PLN	5.560	70	0	70	0,00
SSB	07.2023	CLP	40.670.241	$	50.601	0	(93)	(93)	0,00
	10.2023	$	49.984	CLP	40.670.241	92	0	92	0,00
UAG	07.2023	CHF	6.557	€	6.780	62	0	62	0,00
	07.2023	€	6.195	AUD	10.046	19	(85)	(66)	0,00
	07.2023		2.076	CAD	2.976	0	(15)	(15)	0,00
	07.2023		41.376	CHF	40.483	108	(7)	101	0,00
	07.2023		1.730	¥	259.400	0	(85)	(85)	0,00
	07.2023	£	136.140	€	156.513	0	(2.125)	(2.125)	(0,05)
	07.2023	¥	13.690.000		96.049	9.180	0	9.180	0,22
	07.2023	$	458	TRY	10.563	0	(51)	(51)	0,00
	08.2023	CHF	37.615	€	38.487	0	(113)	(113)	0,00
	08.2023	$	52.222	ZAR	1.002.848	589	(23)	566	0,01
	09.2023	ILS	157.989	$	44.127	1.309	0	1.309	0,03
	09.2023	¥	13.440.000	€	90.390	4.541	0	4.541	0,11
						€ 83.521	€ (27.114)	€ 56.407	1,32

ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklassen BM Retail AUD (Hedged) Income II und M Retail AUD (Hedged) Income II die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung		Zu erhaltende Währung		Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
AZD	07.2023	AUD	3	€	2	€ 0	€ 0	€ 0	0,00
	07.2023	€	89	AUD	146	0	0	0	0,00
JPM	07.2023	AUD	5	€	3	0	0	0	0,00
MYI	07.2023	€	37	AUD	59	0	(1)	(1)	0,00
RBC	07.2023		110		180	1	(1)	0	0,00
RYL	07.2023		6		10	0	0	0	0,00
SCX	07.2023		86		143	1	0	1	0,00
UAG	07.2023	AUD	12	€	7	0	0	0	0,00
						€ 2	€ (2)	€ 0	0,00

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklasse Institutional CHF (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung		Zu erhaltende Währung		Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2023	€	958	CHF	927	€ 0	€ (8)	€ (8)	0,00
BRC	07.2023		427		415	0	(2)	(2)	0,00
MBC	07.2023	CHF	34	€	35	0	0	0	0,00
MYI	07.2023		63		65	0	0	0	0,00
	07.2023	€	576	CHF	560	0	(3)	(3)	0,00
UAG	07.2023	CHF	963	€	984	0	(3)	(3)	0,00
	07.2023	€	960	CHF	929	0	(9)	(9)	0,00
	08.2023		943		922	3	0	3	0,00
						€ 3	€ (25)	€ (22)	0,00

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklassen Institutional GBP (Hedged) thesaurierend und Institutional GBP (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung		Zu erhaltende Währung		Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2023	£	70.020	€	81.280	€ 0	€ (310)	€ (310)	(0,01)
BRC	07.2023	€	200.877	£	173.140	876	0	876	0,02
	07.2023	£	22.238	€	25.821	16	(108)	(92)	0,00
CLY	07.2023	€	5.925	£	5.095	12	0	12	0,00
	07.2023	£	9.667	€	11.283	29	(10)	19	0,00
DUB	07.2023	€	31	£	27	0	0	0	0,00
	07.2023	£	52	€	61	0	0	0	0,00
JPM	07.2023	€	228.554	£	196.670	617	0	617	0,02
MBC	07.2023		178.584		154.749	1.738	0	1.738	0,04
	07.2023	£	171.097	€	198.155	1	(1.217)	(1.216)	(0,03)
	08.2023	€	197.813	£	171.005	1.203	0	1.203	0,03
RBC	07.2023		5.917		5.108	35	0	35	0,00
RYL	07.2023		206		178	1	0	1	0,00
SOG	07.2023	£	975	€	1.134	0	(2)	(2)	0,00
UAG	07.2023	€	87.886	£	76.442	1.190	(1)	1.189	0,03
						€ 5.718	€ (1.648)	€ 4.070	0,10

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklasse Institutional ILS (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung		Zu erhaltende Währung		Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BRC	07.2023	€	1.388	ILS	5.600	€ 0	€ (5)	€ (5)	0,00
	07.2023	ILS	81	€	20	0	0	0	0,00
	08.2023	€	13	ILS	52	0	0	0	0,00
CBK	07.2023		1.388		5.600	0	(5)	(5)	0,00
	07.2023	ILS	137	€	35	1	0	1	0,00
MBC	07.2023	€	1.388	ILS	5.600	0	(5)	(5)	0,00
	07.2023	ILS	315	€	79	2	0	2	0,00
	08.2023	€	14	ILS	57	0	0	0	0,00
MYI	07.2023		158		615	0	(6)	(6)	0,00
						€ 3	€ (21)	€ (18)	0,00

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklassen Institutional SGD (Hedged) Accumulation und M Retail SGD (Hedged) Income II die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BRC	07.2023	€ 27.710	SGD 40.144	€ 0	€ (522)	€ (522)	(0,02)
	07.2023	SGD 904	€ 625	13	0	13	0,00
	08.2023	53	36	0	0	0	0,00
GLM	07.2023	€ 27.711	SGD 40.144	0	(523)	(523)	(0,01)
	07.2023	SGD 1.467	€ 994	0	0	0	0,00
MBC	07.2023	€ 27.712	SGD 40.144	0	(524)	(524)	(0,01)
	07.2023	SGD 204	€ 140	1	0	1	0,00
SOG	07.2023	140	95	1	0	1	0,00
UAG	07.2023	831	571	8	0	8	0,00
				€ 23	€ (1.569)	€ (1.546)	(0,04)

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklassen Institutional USD (Hedged) Accumulation, Institutional USD (Hedged) Income II, Investor USD (Hedged) Accumulation, BM Retail USD (Hedged) Income II, E Class USD (Hedged) Accumulation, E Class USD (Hedged) Income, E Class USD (Hedged) Income II, H Institutional USD (Hedged) Accumulation, M Retail USD (Hedged) Income II und T Class USD (Hedged) Accumulation die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
AZD	07.2023	$ 11.570	€ 10.662	€ 67	€ (11)	€ 56	0,00
BOA	07.2023	€ 109.268	$ 117.440	0	(1.624)	(1.624)	(0,04)
	07.2023	$ 307	€ 285	4	0	4	0,00
BPS	07.2023	€ 106.139	$ 114.100	0	(1.556)	(1.556)	(0,04)
	07.2023	$ 108.713	€ 99.217	0	(427)	(427)	(0,01)
	08.2023	€ 99.217	$ 108.865	431	0	431	0,01
BRC	07.2023	$ 564	€ 515	0	(1)	(1)	0,00
CBK	07.2023	108.556	99.848	347	0	347	0,01
	08.2023	€ 99.848	$ 108.708	0	(344)	(344)	(0,01)
CLY	07.2023	$ 3.193	€ 2.978	52	0	52	0,00
DUB	07.2023	4.130	3.806	20	0	20	0,00
JPM	07.2023	€ 31.863	$ 34.067	0	(638)	(638)	(0,01)
	07.2023	$ 109.024	€ 99.848	0	(82)	(82)	0,00
	08.2023	€ 99.848	$ 109.177	85	0	85	0,00
MBC	07.2023	15.277	16.387	0	(257)	(257)	(0,01)
	07.2023	$ 16.078	€ 15.002	265	0	265	0,01
MYI	07.2023	435	395	0	(3)	(3)	0,00
RBC	07.2023	388	356	0	0	0	0,00
SCX	07.2023	9.047	8.280	14	(26)	(12)	0,00
SOG	07.2023	€ 106.139	$ 114.178	0	(1.485)	(1.485)	(0,03)
				€ 1.285	€ (6.454)	€ (5.169)	(0,12)

Summe Freiverkehrsfinanzderivate	**€ 50.767**	**1,19**
Summe Anlagen	**€ 5.015.615**	**117,79**
Sonstige Aktiva und Passiva	**€ (757.404)**	**(17,79)**
Nettovermögen	**€ 4.258.211**	**100,00**

ERLÄUTERUNGEN ZUR AUFSTELLUNG DES WERTPAPIERBESTANDS (Angaben in Tausend*):

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

^ **Das Wertpapier ist in Verzug.**

(a) **Das Wertpapier hat in den letzten zwölf Monaten keine Erträge geliefert.**

(b) **Nullkuponwertpapier.**

(c) **Der Kupon stellt eine Rendite bis zur Endfälligkeit dar.**

(d) **Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.**

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

(f) **Mit dem Fonds verbunden.**

(g) **Bedingt wandelbares Wertpapier.**

Wertpapiere mit einem gesamten beizulegenden Zeitwert von null EUR (31. Dezember 2022: 17.831 EUR) wurden zum 30. Juni 2023 gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte als Sicherheit verpfändet.

Barmittel in Höhe von 1.135 EUR (31. Dezember 2022: 68.086 EUR) wurden zum 30. Juni 2023 gemäß Prime Brokerage-Vereinbarungen und Vereinbarungen, die börsennotierte Aktienoptionsgeschäfte regeln, als Sicherheit für Leerverkäufe und Optionen verpfändet.

Barmittel in Höhe von 163.012 EUR (31. Dezember 2022: 287.910 EUR) wurden zum 30. Juni 2023 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Barmittel in Höhe von 4.020 EUR (31. Dezember 2022: 38.420 EUR) wurden zum 30. Juni 2023 gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. als Sicherheit für Finanzderivate verpfändet.

Beizulegender Zeitwert[1]

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 30. Juni 2023 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie[2]	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	€ 373.327	€ 3.873.229	€ 319	€ 4.246.875
Investmentfonds	404.018	15.843	0	419.861
Pensionsgeschäfte	0	329.566	0	329.566
Finanzderivate[3]	1.520	17.793	0	19.313
Summen	**€ 778.865**	**€ 4.236.431**	**€ 319**	**€ 5.015.615**

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

Kategorie[2]	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	€ 1.030.499	€ 3.100.425	€ 0	€ 4.130.924
Investmentfonds	159.134	345.280	0	504.414
Pensionsgeschäfte	0	124.604	0	124.604
Finanzderivate[3]	40.774	(43.246)	0	(2.472)
Summen	**€ 1.230.407**	**€ 3.527.063**	**€ 0**	**€ 4.757.470**

(1) Siehe Erläuterung 3 in den Erläuterungen zum Abschluss für weitere Informationen.

(2) Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung des Wertpapierbestands.

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

Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC-Finanzderivate und -Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2023 und 31. Dezember 2022:

	Zum 30. Jun. 2023			Zum 31. Dez. 2022		
Kontrahent	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-engagement[1]	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-engagement[1]
AZD	€ 56	€ 0	€ 56	€ 50	€ 0	€ 50
BOA	(3.154)	3.090	(64)	3.446	(3.570)	(124)
BPS	5.516	(4.460)	1.056	4.322	(10.200)	(5.878)
BRC	1.693	(440)	1.253	(7.900)	5.060	(2.840)
CBK	(800)	730	(70)	10.257	(9.740)	517
CLY	83	0	83	(8)	0	(8)
DUB	(13)	0	(13)	12.986	(12.970)	16
GLM	2.336	(1.720)	616	(7.033)	6.920	(113)
GST	k. A.	k. A.	k. A.	(2)	0	(2)
JPM	101	200	301	7.259	(7.080)	179
MBC	7.473	(7.780)	(307)	36.023	(33.640)	2.383
MEI	k. A.	k. A.	k. A.	80	(4.040)	(3.960)
MYI	1.692	(1.468)	224	(126)	0	(126)
RBC	82	(150)	(68)	(3.115)	2.470	(645)
RYL	9	0	9	(7.748)	7.780	32
SCX	1.516	(1.580)	(64)	(15.297)	14.720	(577)
SOG	19.686	(21.650)	(1.964)	(1.445)	1.300	(145)
SSB	(1)	0	(1)	k. A.	k. A.	k. A.
UAG	14.492	(15.120)	(628)	(341)	170	(171)

(1) Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären.

Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung des Wertpapierbestands zum 30. Juni 2023:

	30. Jun. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	78,89	65,24
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	20,85	15,48
Sonstige übertragbare Wertpapiere	0,00	0,05
Investmentfonds	9,86	9,86
Pensionsgeschäfte	7,74	2,44
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	(0,08)	0,48
Zentral abgerechnete Finanzderivate	(0,66)	(1,15)
Freiverkehrsfinanzderivate	1,19	0,61
Umgekehrte Pensionsgeschäfte	k. A.	(0,35)

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 30. Juni 2023 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	30. Jun. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
Unternehmensanleihen und Wechsel	8,32	3,28
Wandelanleihen & Wechsel	0,34	0,26
US-Regierungsbehörden	21,79	k. A.
US-Schatzobligationen	17,21	k. A.
Non-Agency-MBS	4,02	1,78
Forderungsbesicherte Wertpapiere	7,73	6,77
Staatsemissionen	3,99	0,72
Stammaktien	20,79	39,19
Vorzugswertpapiere	0,00	k. A.
Bezugsrechte	k. A.	0,00
Real Estate Investment Trusts	0,48	0,26
Kurzfristige Instrumente	15,07	28,51
Investmentfonds	9,86	9,86
Pensionsgeschäfte	7,74	2,44
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	(0,08)	0,51
Optionskauf		
Optionen auf Indizes	k. A.	0,00
Verkaufsoptionen		
Optionen auf Indizes	k. A.	(0,03)
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen - Schutzverkauf	0,00	0,00
Credit Default Swaps auf Kreditindizes — Schutzverkauf	0,20	0,30
Zinsswaps	(0,86)	(1,45)
Freiverkehrsfinanzderivate		
Optionskauf		
Devisenoptionen	k. A.	0,14
Verkaufsoptionen		
Credit Default Swaptions auf Kreditindizes	k. A.	0,00
Devisenoptionen	k. A.	(0,04)
Zinsswapoptionen	k. A.	(0,05)
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen - Schutzkauf	0,00	0,00
Total Return Swaps auf Indizes	(0,07)	0,01
Devisenterminkontrakte	1,32	1,12
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	(0,06)	(0,57)
Sonstige Aktiva und Passiva	(17,79)	6,99
Nettovermögen	100,00	100,00

BESCHREIBUNG		PARI (000S)		MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE					
ARGENTINIEN					
STAATSEMISSIONEN					
Autonome Stadt Buenos Aires					
95,317 % fällig am 29.03.2024 (a)	ARS	88.177	$	176	0,01
95,645 % fällig am 22.02.2028 (a)		52.420		102	0,00
Summe Argentinien				278	0,01
ASERBAIDSCHAN					
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL					
SOCAR Turkey Enerji AS Via Steas Funding DAC					
7,230 % fällig am 17.03.2026	$	2.900		2.835	0,10
BRASILIEN					
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL					
Banco BTG Pactual S.A.					
8,300 % fällig am 15.08.2024	BRL	228.000		45.861	1,65
Odebrecht Oil & Gas Finance Ltd.					
0,000 % fällig am 31.07.2023 (d)(g)	$	485		1	0,00
Oi S.A.					
0,000 % fällig am 25.02.2035	BRL	4.559		801	0,03
Swiss Insured Brazil Power Finance SARL					
9,850 % fällig am 16.07.2032		194.259		37.146	1,33
Vale S.A.					
0,000 % (g)		99.420		6.338	0,23
Summe Brasilien				90.147	3,24
CAYMAN INSELN					
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL					
Interoceanica Finance Ltd.					
0,000 % fällig am 30.11.2025 (d)	$	253		233	0,01
Kaisa Group Holdings Ltd.					
9,750 % fällig am 28.09.2023 ^		8.000		535	0,02
10,500 % fällig am 15.01.2025 ^		1.900		127	0,00
10,875 % fällig am 23.07.2023 ^		500		32	0,00
11,700 % fällig am 11.11.2025 ^		1.900		127	0,00
Poinsettia Finance Ltd.					
6,625 % fällig am 17.06.2031		7.611		6.290	0,23
Summe Cayman Inseln				7.344	0,26
CHILE					
STAATSEMISSIONEN					
Bonos de la Tesoreria de la Republica en Pesos					
2,300 % fällig am 01.10.2028	CLF	6.890.000		7.414	0,27
4,500 % fällig am 15.10.2023		180.447		222	0,01
5,000 % fällig am 01.10.2028		10.105.000		12.410	0,45
6,000 % fällig am 01.04.2033		46.955.000		61.969	2,22
6,000 % fällig am 01.01.2043		655.000		905	0,03
7,000 % fällig am 01.05.2034		530.000		761	0,03
Summe Chile				83.681	3,01
CHINA					
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL					
Flourish Century					
6,600 % fällig am 04.02.2022 ^(j)	$	2.800		310	0,01
STAATSEMISSIONEN					
China Government International Bond					
2,600 % fällig am 01.09.2032	CNY	201.010		27.420	0,98
2,620 % fällig am 25.09.2029		308.300		42.462	1,52
3,020 % fällig am 27.05.2031		162.700		22.995	0,83
3,030 % fällig am 11.03.2026		62.810		8.836	0,32
3,120 % fällig am 25.10.2052		48.980		6.839	0,25
3,270 % fällig am 19.11.2030		23.300		3.367	0,12
3,280 % fällig am 03.12.2027		164.010		23.472	0,84
3,810 % fällig am 14.09.2050	CNY	89.400	$	13.939	0,50
				149.330	5,36
Summe China				149.640	5,37
KOLUMBIEN					
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL					
Empresas Publicas de Medellin ESP					
7,625 % fällig am 10.09.2024	COP	7.839.000		1.751	0,06
STAATSEMISSIONEN					
Colombia Government International Bond					
9,850 % fällig am 28.06.2027		25.455.000		5.880	0,21
Colombian TES					
2,250 % fällig am 18.04.2029 (f)		40.003.389		8.660	0,31
3,750 % fällig am 25.02.2037		23.048.079		5.215	0,19
4,750 % fällig am 04.04.2035 (f)		7.763.930		1.928	0,07
6,250 % fällig am 09.07.2036		17.966.000		3.128	0,11
7,000 % fällig am 26.03.2031		62.521.200		12.633	0,45
7,000 % fällig am 30.06.2032		22.623.200		4.456	0,16
7,250 % fällig am 18.10.2034		21.297.000		4.110	0,15
7,250 % fällig am 26.10.2050		16.745.900		2.818	0,10
7,750 % fällig am 18.09.2030		75.745.600		16.167	0,58
9,250 % fällig am 28.05.2042		68.264.600		14.639	0,53
13,250 % fällig am 09.02.2033		73.797.400		20.853	0,75
				100.487	3,61
Summe Kolumbien				102.238	3,67
TSCHECHISCHE REPUBLIK					
STAATSEMISSIONEN					
Czech Republic Government International Bond					
0,950 % fällig am 15.05.2030	CZK	511.840		18.776	0,67
1,200 % fällig am 13.03.2031		381.000		13.951	0,50
1,750 % fällig am 23.06.2032		144.700		5.417	0,20
2,000 % fällig am 13.10.2033		297.100		11.062	0,40
2,750 % fällig am 23.07.2029		426.500		17.846	0,64
3,500 % fällig am 30.05.2035		146.600		6.253	0,23
4,200 % fällig am 04.12.2036		149.900		6.784	0,24
4,900 % fällig am 14.04.2034		23.300		1.124	0,04
5,000 % fällig am 30.09.2030		277.000		13.208	0,47
Summe Tschechische Republik				94.421	3,39
DÄNEMARK					
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL					
Jyske Realkredit A/S					
1,500 % fällig am 01.10.2053	DKK	0		0	0,00
Nordea Kredit Realkreditaktieselskab					
1,000 % fällig am 01.10.2050		0		0	0,00
1,500 % fällig am 01.10.2053		0		0	0,00
Realkredit Danmark A/S					
1,500 % fällig am 01.10.2053		0		0	0,00
				0	0,00
Summe Dänemark				0	0,00
DOMINIKANISCHE REPUBLIK					
STAATSEMISSIONEN					
Zentralbanknoten der Dominikanischen Republik					
12,000 % fällig am 03.10.2025	DOP	310.500	$	5.901	0,21
13,000 % fällig am 05.12.2025		1.128.200		22.010	0,79
13,000 % fällig am 30.01.2026		442.100		8.649	0,31
Dominican Republic Government International Bond					
13,625 % fällig am 03.02.2033		1.214.600		27.311	0,98
13,625 % fällig am 10.02.2034		483.800		11.049	0,40
Summe Dominikanische Republik				74.920	2,69
UNGARN					
STAATSEMISSIONEN					
Ungarische Entwicklungsbank					
6,500 % fällig am 29.06.2028	$	13.200		13.091	0,47
Hungary Government International Bond					
4,500 % fällig am 23.03.2028	HUF	1.272.700		3.263	0,11
4,750 % fällig am 24.11.2032		2.337.900		5.807	0,21
6,750 % fällig am 22.10.2028		11.684.600		32.808	1,18
Summe Ungarn				54.969	1,97
INDONESIEN					
STAATSEMISSIONEN					
Indonesia Government International Bond					
6,375 % fällig am 15.08.2028	IDR	74.197.000		5.051	0,18
6,375 % fällig am 15.04.2032		321.879.000		21.619	0,78
6,500 % fällig am 15.02.2031		264.478.000		17.840	0,64
7,000 % fällig am 15.09.2030		523.608.000		36.345	1,31
7,000 % fällig am 15.02.2033		157.625.000		11.094	0,40
7,125 % fällig am 15.06.2038		148.515.000		10.518	0,38
7,125 % fällig am 15.06.2042		34.279.000		2.392	0,09
7,125 % fällig am 15.06.2043		104.185.000		7.367	0,26
7,500 % fällig am 15.06.2035		236.780.000		17.119	0,61
7,500 % fällig am 15.05.2038		109.016.000		7.932	0,28
7,500 % fällig am 15.04.2040		164.179.000		11.875	0,43
8,250 % fällig am 15.05.2029		83.961.000		6.172	0,22
8,375 % fällig am 15.03.2034		199.861.000		15.344	0,55
Summe Indonesien				170.668	6,13
INTERNATIONALE					
KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG					
Project Mercury					
TBD % fällig am 17.07.2030	€	5.000		5.455	0,20
Staatliche Energiegesellschaft der Republik Aserbaidschan					
TBD % fällig am 26.11.2024	$	10.933		10.660	0,38
Summe International				16.115	0,58
IRLAND					
FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE					
Black Diamond CLO DAC					
4,060 % fällig am 20.01.2032	€	753		810	0,03
BNPP AM Euro CLO DAC					
3,777 % fällig am 15.04.2031		500		534	0,02

BESCHREIBUNG		PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
Carlyle Euro CLO DAC				
3,877 % fällig am 15.01.2031	€	4.580	$ 4.891	0,18
Carlyle Global Market Strategies Euro CLO Ltd.				
4,073 % fällig am 15.11.2031		1.900	2.034	0,07
Dryden Euro CLO DAC				
4,183 % fällig am 15.05.2034		7.400	7.900	0,28
Summe Irland			16.169	0,58
ISRAEL				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Bank Leumi Le-Israel B.M.				
7,129 % fällig am 18.07.2033 (i)	$	2.100	2.081	0,07
STAATSEMISSIONEN				
Israel Government International Bond				
1,500 % fällig am 30.11.2023	ILS	76.200	20.275	0,73
Summe Israel			22.356	0,80
ELFENBEINKÜSTE				
KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG				
Elfenbeinküste				
7,985 % fällig am 19.03.2027	€	6.320	6.723	0,24
JERSEY, KANALINSELN				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Corsair International Ltd.				
7,772 % fällig am 28.01.2027		4.400	4.776	0,17
8,122 % fällig am 28.01.2029		2.800	3.032	0,11
Summe Jersey, Kanalinseln			7.808	0,28
		AKTIEN		
LUXEMBURG				
STAMMAKTIEN				
DrillCo Holding Lux S.A. (c)		3.120	60	0,00
DrillCo Holding Lux S.A. (c)(j)		7.882	151	0,01
Summe Stammaktien			211	0,01
		PARI (000S)		
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Constellation Oil Services Holding S.A. (3,000 % bar und 4,000 % PIK)				
3,000 % fällig am 31.12.2026 (b)	$	341	202	0,01
FORESEA Holding S.A.				
7,500 % fällig am 15.06.2030		137	121	0,00
			323	0,01
Summe Luxemburg			534	0,02
MALAYSIA				
STAATSEMISSIONEN				
Malaysia Government International Bond				
2,632 % fällig am 15.04.2031	MYR	74.660	14.724	0,53
3,582 % fällig am 15.07.2032		85.804	18.056	0,65
3,733 % fällig am 15.06.2028		30.750	6.628	0,24
3,757 % fällig am 22.05.2040		19.662	4.031	0,14
3,800 % fällig am 17.08.2023		176.400	37.824	1,36
3,885 % fällig am 15.08.2029		26.300	5.678	0,20
3,899 % fällig am 16.11.2027		25.050	5.437	0,19
4,065 % fällig am 15.06.2050		40.939	8.566	0,31
4,254 % fällig am 31.05.2035		35.492	7.774	0,28
4,504 % fällig am 30.04.2029		6.420	1.434	0,05
4,696 % fällig am 15.10.2042		100	23	0,00
4,762 % fällig am 07.04.2037		79.180	18.265	0,66
Malaysia Government Investment Issue				
3,422 % fällig am 30.09.2027		58.100	12.367	0,44
3,447 % fällig am 15.07.2036		24.190	4.884	0,18
3,465 % fällig am 15.10.2030		105.520	22.119	0,79
3,990 % fällig am 15.10.2025		85.989	18.643	0,67
4,130 % fällig am 09.07.2029		55.160	12.076	0,43
4,193 % fällig am 07.10.2032		108.555	23.855	0,86
4,258 % fällig am 26.07.2027		14.130	3.107	0,11
4,369 % fällig am 31.10.2028		220.103	48.759	1,75

BESCHREIBUNG		PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
4,417 % fällig am 30.09.2041	MYR	33.593	$ 7.440	0,27
Summe Malaysia			281.690	10,11
		AKTIEN		
MEXIKO				
STAMMAKTIEN				
Hipotecaria Su Casita S.A. (c)		212.074	0	0,00
		PARI (000S)		
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
America Movil S.A.B. de C.V.				
8,460 % fällig am 18.12.2036	MXN	1.800	93	0,00
Corp. GEO S.A.B. de C.V.				
8,875 % fällig am 25.09.2014 ^	$	250	0	0,00
9,250 % fällig am 30.06.2020 ^		700	0	0,00
Hipotecaria Su Casita S.A. de C.V.				
9,620 % fällig am 28.06.2018 ^	MXN	22.130	0	0,00
Urbi Desarrollos Urbanos S.A.B. de C.V.				
8,790 % fällig am 09.12.2014 ^		29.700	0	0,00
			93	0,00
STAATSEMISSIONEN				
Mexico Government International Bond				
5,500 % fällig am 04.03.2027		1.644.100	85.106	3,06
5,750 % fällig am 05.03.2026		253.900	13.496	0,48
7,000 % fällig am 03.09.2026		172.700	9.408	0,34
7,500 % fällig am 03.06.2027		697.100	38.596	1,39
7,500 % fällig am 26.05.2033		241.300	12.983	0,47
7,750 % fällig am 29.05.2031		385.002	21.267	0,76
7,750 % fällig am 13.11.2042		322.900	16.911	0,61
8,000 % fällig am 07.11.2047		278.900	14.893	0,53
8,000 % fällig am 31.07.2053		138.700	7.353	0,26
8,500 % fällig am 31.05.2029		608.600	35.120	1,26
8,500 % fällig am 18.11.2038		522.200	29.720	1,07
			284.853	10,23
Summe Mexiko			284.946	10,23
NIEDERLANDE				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Angola Via Avenir BV				
10,163 % fällig am 07.12.2023	$	1.580	1.572	0,06
12,772 % fällig am 03.07.2023		345	345	0,01
Summe Niederlande			1.917	0,07
NIGERIA				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
BOI Finance BV				
7,500 % fällig am 16.02.2027	€	3.600	3.392	0,12
PERU				
STAATSEMISSIONEN				
Peru Government International Bond				
5,350 % fällig am 12.08.2040	PEN	2.300	533	0,02
5,400 % fällig am 12.08.2034		52.900	12.942	0,46
5,940 % fällig am 12.02.2029		93.600	25.375	0,91
6,150 % fällig am 12.08.2032		20.606	5.449	0,20
6,900 % fällig am 12.08.2037		6.000	1.643	0,06
7,300 % fällig am 12.08.2033		194.300	55.348	1,99
Summe Peru			101.290	3,64
PHILIPPINEN				
STAATSEMISSIONEN				
Philippines Government International Bond				
6,250 % fällig am 14.01.2036	PHP	52.000	939	0,03
6,750 % fällig am 15.09.2032		105.040	1.955	0,07
Summe Philippinen			2.894	0,10
POLEN				

BESCHREIBUNG		PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
STAATSEMISSIONEN				
Poland Government International Bond				
1,250 % fällig am 25.10.2030	PLN	30.486	$ 5.595	0,20
1,750 % fällig am 25.04.2032		26.500	4.767	0,17
2,500 % fällig am 25.07.2027		19.800	4.327	0,16
2,750 % fällig am 25.04.2028 (k)		243.700	52.970	1,90
2,750 % fällig am 25.10.2029		107.700	22.643	0,81
3,750 % fällig am 25.05.2027		72.600	16.704	0,60
6,000 % fällig am 25.10.2033		54.000	13.528	0,49
7,500 % fällig am 25.07.2028 (k)		86.700	23.058	0,83
Summe Polen			143.592	5,16
KATAR				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
QNB Finance Ltd.				
6,900 % fällig am 23.01.2025	IDR	276.200.000	18.447	0,66
RUMÄNIEN				
STAATSEMISSIONEN				
Romania Government International Bond				
3,650 % fällig am 28.07.2025	RON	42.200	8.816	0,32
4,150 % fällig am 26.01.2028		77.600	15.449	0,55
4,250 % fällig am 28.04.2036		103.700	17.796	0,64
4,750 % fällig am 11.10.2034		62.000	11.509	0,41
4,850 % fällig am 25.07.2029		6.600	1.322	0,05
5,000 % fällig am 12.02.2029		12.600	2.557	0,09
Summe Rumänien			57.449	2,06
RUSSLAND				
STAATSEMISSIONEN				
Russia Government International Bond				
1,125 % fällig am 20.11.2027 ^	€	100	51	0,00
5,100 % fällig am 28.03.2035 ^	$	1.200	534	0,02
7,700 % fällig am 23.03.2033 ^	RUB	1.088.800	4.380	0,16
Summe Russland			4.965	0,18
SERBIEN				
STAATSEMISSIONEN				
Serbia Government International Bond				
4,500 % fällig am 20.08.2032	RSD	371.800	3.070	0,11
SÜDAFRIKA				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Entwicklungsbank für das südliche Afrika				
8,600 % fällig am 21.10.2024 (j)	ZAR	221.300	11.513	0,41
Eskom Holdings SOC Ltd.				
0,000 % fällig am 18.08.2027 (d)		100.100	2.683	0,10
0,000 % fällig am 31.12.2032 (d)		254.000	2.858	0,10
			17.054	0,61
STAATSEMISSIONEN				
South Africa Government International Bond				
2,000 % fällig am 31.01.2025 (f)		69.734	3.583	0,13

BESCHREIBUNG		PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
6,250 % fällig am 31.03.2036	ZAR	114.500	$ 3.871	0,14
6,500 % fällig am 28.02.2041		184.751	5.794	0,21
7,000 % fällig am 28.02.2031		665.346	28.203	1,01
8,000 % fällig am 31.01.2030		511.827	23.948	0,86
8,250 % fällig am 31.03.2032		567.780	25.288	0,91
8,500 % fällig am 31.01.2037		697.900	28.264	1,02
8,750 % fällig am 31.01.2044		432.400	16.795	0,60
8,875 % fällig am 28.02.2035		213.800	9.276	0,33
9,000 % fällig am 31.01.2040		489.800	19.941	0,72
10,500 % fällig am 21.12.2026 (k)		1.961.732	107.847	3,88
10,500 % fällig am 21.12.2026		590.000	32.435	1,16
			305.245	10,97
Summe Südafrika			322.299	11,58
SÜDKOREA				
STAATSEMISSIONEN				
Export-Import Bank of Korea				
7,250 % fällig am 07.12.2024	IDR	51.400.000	3.465	0,12
8,000 % fällig am 15.05.2024		2.800.000	189	0,01
Korea National Oil Corp.				
4,750 % fällig am 03.04.2026		6.300	6.182	0,22
Summe Südkorea			9.836	0,35
SUPRANATIONAL				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Asian Development Bank				
4,700 % fällig am 12.03.2024	MXN	68.600	3.783	0,13
Internationale Bank für Wiederaufbau und Entwicklung				
6,250 % fällig am 12.01.2028	ID	320.000.000	21.646	0,78
International Finance Corp.				
8,000 % fällig am 09.10.2023		6.900.000	462	0,02
Summe Supranational			25.891	0,93
TANSANIA				
KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG				
The Ministry of Finance and Planning, Government of the United Republic of Tanzania				
9,048 % fällig am 26.04.2028	€	8.182	8.804	0,32
THAILAND				
STAATSEMISSIONEN				
Thailand Government International Bond				
2,000 % fällig am 17.06.2042	THB	72.330	1.754	0,06
2,350 % fällig am 17.06.2026		1.871.124	53.034	1,90
2,650 % fällig am 17.06.2028		2.263.201	64.825	2,33
2,875 % fällig am 17.06.2046		73.500	1.970	0,07
3,350 % fällig am 17.06.2033		68.650	2.067	0,07
3,390 % fällig am 17.06.2037		134.400	4.042	0,15
3,400 % fällig am 17.06.2036		477.854	14.374	0,52
3,450 % fällig am 17.06.2043		569.545	17.049	0,61
3,775 % fällig am 25.06.2032		108.429	3.377	0,12

BESCHREIBUNG		PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
4,875 % fällig am 22.06.2029	THB	438.082	$ 14.047	0,51
Summe Thailand			176.539	6,34
TÜRKEI				
KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG				
SOCAR Turkey Enerji A/S				
6,553 % fällig am 11.08.2026	€	9.900	10.477	0,38
VEREINIGTE ARABISCHE EMIRATE				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
ADCB Finance Cayman Ltd.				
7,500 % fällig am 15.10.2029	IDR	29.000.000	1.995	0,07
8,160 % fällig am 29.04.2029		323.000.000	22.712	0,82
			24.707	0,89
KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG				
NMC OpCo Ltd.				
11,255 % fällig am 25.03.2027	AED	28.858	7.935	0,28
Summe Vereinigte Arabische Emirate			32.642	1,17
GROSSBRITANNIEN				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Petra Diamonds U.S. Treasury PLC (6,066 % bar und 3,967 % PIK)				
10,033 % fällig am 08.03.2026 (b)	$	843	789	0,03
NON-AGENCY-MBS				
Canada Square Funding PLC				
5,316 % fällig am 17.01.2059	£	1.741	2.201	0,08
Polaris PLC				
6,154 % fällig am 27.05.2057		322	409	0,01
Rochester Financing PLC				
5,602 % fällig am 18.12.2044		1.705	2.142	0,07
Stratton Mortgage Funding PLC				
5,765 % fällig am 12.03.2052		377	478	0,02
Tower Bridge Funding PLC				
5,629 % fällig am 20.12.2063		1.302	1.648	0,06
Warwick Finance Residential Mortgages PLC				
0,000 % fällig am 21.12.2049 (d)		0	522	0,02
			7.400	0,26
Summe Großbritannien			8.189	0,29
USA				
FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE				
Citigroup Mortgage Loan Trust				
5,450 % fällig am 25.10.2036	$	432	278	0,01
5,470 % fällig am 25.12.2036		1.267	712	0,03
GSAMP Trust				
5,200 % fällig am 25.12.2046		448	226	0,01
5,240 % fällig am 25.01.2037		878	514	0,02
Lehman XS Trust				
5,058 % fällig am 25.01.2036 ^		1.558	1.447	0,05
MASTR Asset-Backed Securities Trust				
6,300 % fällig am 25.08.2037		646	536	0,02
Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust				
5,380 % fällig am 25.11.2036		7.057	3.892	0,14
5,450 % fällig am 25.06.2036		169	143	0,01
6,305 % fällig am 25.01.2035		1.732	1.553	0,06

BESCHREIBUNG		PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
NovaStar Mortgage Funding Trust				
5,490 % fällig am 25.01.2037	$	1.742	$ 610	0,02
Option One Mortgage Loan Trust				
5,370 % fällig am 25.04.2037		481	341	0,01
Park Place Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates				
5,885 % fällig am 25.08.2035		87	83	0,00
Residential Asset Securities Corp. Trust				
6,800 % fällig am 25.07.2035		2.095	2.040	0,07
Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust				
5,370 % fällig am 25.10.2037		5.124	3.295	0,12
Wells Fargo Home Equity Asset-Backed Securities Trust				
5,470 % fällig am 25.07.2036		1.300	1.234	0,04
			16.904	0,61
		AKTIEN		
STAMMAKTIEN				
ENERGIE				
Constellation Oil Services Holding S.A. 'B' (c)(j)		376.971	41	0,00
		PARI (000S)		
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Ford Motor Credit Co. LLC				
4,535 % fällig am 06.03.2025	£	400	484	0,02
Rio Oil Finance Trust				
8,200 % fällig am 06.04.2028	$	2.904	2.923	0,10
9,250 % fällig am 06.07.2024		836	844	0,03
9,750 % fällig am 06.01.2027		542	559	0,02
			4.810	0,17
KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG				
Ecopetrol S.A.				
TBD % fällig am 17.08.2024		10.700	10.535	0,38
NON-AGENCY-MBS				
Banc of America Mortgage Trust				
3,896 % fällig am 25.02.2036 ^		1	1	0,00
BCAP LLC Trust				
3,676 % fällig am 26.05.2037		3.337	3.009	0,11
Bear Stearns Adjustable Rate Mortgage Trust				
3,887 % fällig am 25.05.2047 ^		11	10	0,00
4,033 % fällig am 25.01.2035		1	1	0,00
4,042 % fällig am 25.03.2035		6	6	0,00
Bear Stearns ALT-A Trust				
3,744 % fällig am 25.04.2037		6.405	4.786	0,17
4,117 % fällig am 25.10.2035 ^		258	219	0,01
Citigroup Mortgage Loan Trust				
3,974 % fällig am 25.09.2037 ^		2.722	2.390	0,09
4,321 % fällig am 25.03.2034		1	1	0,00
Countrywide Alternative Loan Trust				
5,510 % fällig am 25.04.2046		100	89	0,00
5,797 % fällig am 20.12.2035		422	394	0,01
6,000 % fällig am 25.06.2036		4.021	2.252	0,08
Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust				
3,884 % fällig am 25.11.2037		318	291	0,01
5,950 % fällig am 25.03.2035		37	32	0,00
FWD Securitization Trust				
2,240 % fällig am 25.01.2050		562	511	0,02
GSMPS Mortgage Loan Trust				
5,500 % fällig am 25.01.2036		131	107	0,00
GSR Mortgage Loan Trust				
3,935 % fällig am 25.01.2036 ^		4	4	0,00
Impac CMB Trust				
5,790 % fällig am 25.03.2035		80	73	0,00
IndyMac Mortgage Loan Trust				
3,062 % fällig am 25.11.2037		204	167	0,01
5,490 % fällig am 25.11.2036		5.293	5.138	0,18
5,510 % fällig am 25.02.2037		382	369	0,01
JPMorgan Resecuritization Trust				
2,500 % fällig am 25.03.2056		160	151	0,01
Lehman XS Trust				
5,530 % fällig am 25.09.2046		1.470	1.258	0,05
Morgan Stanley Mortgage Loan Trust				
6,115 % fällig am 25.06.2036		1	1	0,00

BESCHREIBUNG		PARI (000S)		MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
Residential Accredit Loans, Inc. Trust					
5,500 % fällig am 25.03.2037 ^	$	296	$	227	0,01
Sequoia Mortgage Trust					
3,604 % fällig am 20.01.2038 ^		234		181	0,01
Structured Asset Mortgage Investments Trust					
5,300 % fällig am 25.02.2037		601		542	0,02
WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust					
3,772 % fällig am 25.02.2037 ^		23		20	0,00
5,520 % fällig am 25.05.2034		11		104	0,00
Wells Fargo Mortgage-Backed Securities Trust					
4,478 % fällig am 25.10.2036		263		244	0,01
				22.578	0,81
US-REGIERUNGSBEHÖRDEN					
Fannie Mae					
3,996 % fällig am 01.07.2035		8		8	0,00
Summe USA				54.876	1,97
URUGUAY					
STAATSEMISSIONEN					
Uruguay Government International Bond					
3,700 % fällig am 26.06.2037 (f)	UYU	140.338		3.893	0,14
3,875 % fällig am 02.07.2040 (f)(k)		260.887		7.359	0,26
Summe Uruguay				11.252	0,40
SAMBIA					
STAATSEMISSIONEN					
Zambia Government International Bond					
13,000 % fällig am 25.01.2031	ZMW	145.000		4.876	0,18

BESCHREIBUNG		PARI (000S)		MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
KURZFRISTIGE INSTRUMENTE					
COMMERCIAL PAPER					
Amcor PLC					
5,450 % fällig am 07.07.2023	$	250	$	250	0,01
Dominion Resources, Inc.					
5,430 % fällig am 31.07.2023		250		249	0,01
Duke Energy Corp.					
5,400 % fällig am 10.07.2023		500		499	0,02
Electricite de France S.A.					
5,510 % fällig am 03.08.2023		1.975		1.965	0,07
5,510 % fällig am 04.08.2023		1.925		1.914	0,07
Enbridge, Inc.					
5,440 % fällig am 20.07.2023		4.900		4	0,17
5,450 % fällig am 26.07.2023		500		498	0,02
5,480 % fällig am 17.07.2023		1.100		1.097	0,04
Enel Finance America LLC					
5,450 % fällig am 24.07.2023		2.800		2.790	0,10
J.M. Smucker Co.					
5,450 % fällig am 12.07.2023		250		250	0,01
Mondelez International, Inc.					
5,370 % fällig am 25.07.2023		1.300		1.295	0,04
5,400 % fällig am 19.07.2023		500		499	0,02
5,430 % fällig am 13.07.2023		300		299	0,01
National Grid Holdings Ltd.					
5,450 % fällig am 13.07.2023		500		499	0,02
				16.989	0,61
ARGENTINA TREASURY BILLS					
(28,578) % fällig am 18.10.2023 (d)(e)	ARS	154.015		305	0,01
(12,549) % fällig am 23.11.2023 (d)(e)		163.227		329	0,01
				634	0,02

BESCHREIBUNG		PARI (000S)		MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
HUNGARY TREASURY BILLS					
16,220 % fällig am 06.07.2023 (d)(e)	HUF	20.973.000	$	61.221	2,20
Summe kurzfristige Instrumente				78.844	2,83
Summe Übertragbare Wertpapiere				**$ 2.549.023**	**91,52**
		AKTIEN			
INVESTMENTFONDS					
ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN					
PIMCO Funds: Global Investors Series plc - Asia Strategic Interest Bond Fund (h)		250.000	$	2.235	0,08
PIMCO Funds: Global Investors Series plc - Emerging Local Bond ESG Fund (h)		122.324		1.450	0,05
PIMCO Funds: Global Investors Series plc - PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund (h)		2.453.310		26.103	0,94
PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (h)		23.593.014		234.938	8,43
PIMCO Specialty Funds Ireland p.l.c. - PIMCO China Bond Fund (h)		384.409		5.010	0,18
				269.736	9,68
Summe Investmentfonds				**$ 269.736**	**9,68**

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

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

FUTURES

Beschreibung	Art	Ablauf-monat	Anzahl der Kontrakte		Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Euro-Bobl September Futures	Short	09.2023	91	$	150	0,01
Euro-Bund 10-Year Bond September Futures	Long	09.2023	36		(50)	0,00
U.S. Treasury 10-Year Note September Futures	Short	09.2023	62		120	0,00
U.S. Treasury 10-Year Ultra September Futures	Short	09.2023	3		4	0,00
U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond September Futures	Short	09.2023	3		(5)	0,00
				$	219	0,01
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate				**$**	**219**	**0,01**

ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)

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

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMMISSIONEN - SCHUTZVERKAUF[1]

Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits-datum		Nenn-betrag[2]		Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Barclays Bank PLC	1,000 %	20.12.2023	€	1.200	$	0	0,00
General Electric Co.	1,000	20.12.2023	$	1.100		(12)	0,00
					$	(12)	0,00

ZINSSWAPS

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits-datum		Nenn-betrag		Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Erhalt	1-Day INR-MIBOR Compounded-OIS	6,250 %	16.03.2032	INR	1.538.910	$	319	0,01
Zahlung	1-Day INR-MIBOR Compounded-OIS	6,750	15.03.2028		1.480.963		267	0,01
Zahlung	1-Day SGD-SIBCSORA Compounded-OIS	2,750	15.03.2028	SGD	4.900		(48)	0,00
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,250	21.06.2028	$	26.400		1.000	0,04
Zahlung	1-Year BRL-CDI	4,870	02.01.2024	BRL	242.300		(4.718)	(0,17)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	5,660	02.01.2025		183.200		(3.524)	(0,13)

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits-datum		Nenn-betrag		Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Zahlung	1-Year BRL-CDI	5,680 %	02.01.2024	BRL	19.200	$	(324)	(0,01)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	6,140	04.01.2027		528.200		(9.141)	(0,33)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	6,710	02.01.2025		13.900		(209)	(0,01)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	6,950	04.01.2027		800		(11)	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	7,480	02.01.2025		119.400		(1.560)	(0,06)
Erhalt	1-Year BRL-CDI	8,075	02.01.2024		120.000		1.951	0,07
Erhalt	1-Year BRL-CDI	8,675	04.01.2027		19.900		172	0,01
Zahlung	1-Year BRL-CDI	10,565	04.01.2027		259.100		570	0,02
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,140	04.01.2027		157.000		1.393	0,05
Erhalt	1-Year BRL-CDI	11,244	02.01.2026		198.600		(789)	(0,03)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,405	02.01.2029		13.600		61	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,420	02.01.2026		226.000		1.024	0,04
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,810	02.01.2025		75.920		148	0,01
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,845	02.01.2025		186.600		134	0,01
Zahlung	1-Year BRL-CDI	12,005	02.01.2025		177.400		124	0,01
Zahlung	1-Year BRL-CDI	12,090	04.01.2027		127.500		1.147	0,04
Zahlung	1-Year BRL-CDI	12,091	04.01.2027		103.330		930	0,03
Erhalt	1-Year BRL-CDI	12,350	01.07.2024		288.000		(149)	(0,01)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	12,425	02.01.2025		172.800		369	0,01
Erhalt	1-Year BRL-CDI	12,490	01.07.2024		312.400		(247)	(0,01)
Erhalt	1-Year BRL-CDI	12,533	02.01.2029		96.500		(1.260)	(0,04)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	12,595	01.07.2024		276.600		304	0,01
Zahlung	1-Year BRL-CDI	12,684	02.01.2029		104.300		1.449	0,05
Erhalt	1-Year BRL-CDI	12,740	02.01.2025		42.600		(173)	(0,01)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	12,746	02.01.2029		114.100		1.626	0,06
Erhalt	1-Year BRL-CDI	12,850	02.01.2025		67.400		(286)	(0,01)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	13,080	01.07.2024		542.300		1.070	0,04
Erhalt	1-Year BRL-CDI	13,218	02.01.2029		212.500		(3.592)	(0,13)
Zahlung	3-Month CNY-CNREPOFIX	2,250	21.12.2027	CNY	151.070		377	0,01
Zahlung	3-Month CNY-CNREPOFIX	2,500	16.03.2027		197.410		398	0,02
Zahlung	3-Month CNY-CNREPOFIX	2,625	16.12.2025		30.320		41	0,00
Zahlung	3-Month CNY-CNREPOFIX	2,750	15.03.2028		108.240		171	0,01
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	3,125	15.01.2026	COP	3.301.000		50	0,00
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	4,005	20.08.2028		53.353.700		(771)	(0,03)
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	4,075	26.11.2025		13.240.170		255	0,01
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	4,115	01.02.2031		14.558.000		144	0,01
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	4,120	01.02.2031		10.388.000		103	0,00
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	4,155	15.01.2031		5.060.000		56	0,00
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	5,175	28.05.2027		32.437.000		(722)	(0,03)
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	5,675	18.06.2031		20.000.000		431	0,02
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	6,130	26.10.2026		10.907.100		174	0,01
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	6,630	07.10.2031		12.820.000		(173)	(0,01)
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	6,640	11.01.2027		31.028.800		395	0,01
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	6,660	07.10.2031		6.347.000		(83)	0,00
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	6,670	11.01.2027		47.000.000		587	0,02
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	6,690	07.10.2031		6.347.000		(80)	0,00
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	7,040	25.01.2027		30.993.600		283	0,01
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	7,080	02.02.2027		9.610.900		82	0,00
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	7,130	31.01.2027		14.472.000		120	0,01
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	7,140	01.02.2027		29.583.000		239	0,01
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	7,380	21.01.2029		9.688.000		33	0,00
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	7,585	14.02.2027		35.037.000		(146)	(0,01)
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	7,860	26.08.2026		12.602.700		40	0,00
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	7,890	08.04.2027		21.093.600		53	0,00
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	7,913	08.04.2027		32.467.300		75	0,00
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	7,940	08.04.2027		16.342.600		34	0,00
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	8,190	13.06.2029		43.754.800		340	0,01
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	8,200	11.03.2027		45.342.000		70	0,00
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	8,240	15.03.2027		15.813.700		31	0,00
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	8,305	28.04.2028		30.230.500		183	0,01
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	8,320	31.03.2027		10.203.000		32	0,00
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	8,360	02.06.2027		58.618.000		192	0,01
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	8,390	13.06.2028		15.910.800		115	0,00
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	8,495	27.04.2030		42.159.000		493	0,02
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	8,560	30.03.2027		4.356.600		21	0,00
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	8,610	26.11.2025		15.715.400		23	0,00
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	8,686	30.03.2027		25.932.000		152	0,01
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	8,820	05.06.2028		41.957.200		(465)	(0,02)
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	8,940	24.03.2030		57.343.000		(1.062)	(0,04)
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	9,040	05.05.2030		15.100.700		285	0,01
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	9,130	23.03.2030		59.209.100		(1.230)	(0,04)
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	9,177	26.11.2025		18.899.000		(29)	0,00
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	9,300	26.03.2031		36.903.760		(951)	(0,03)
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	9,370	17.03.2030		15.942.100		(376)	(0,01)
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	9,393	21.03.2030		37.252.900		(890)	(0,03)
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	9,423	17.03.2030		47.175.600		(1.142)	(0,04)
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	9,490	30.06.2032		9.544.300		305	0,01
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	9,790	20.01.2028		45.916.600		807	0,03
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	9,800	17.01.2028		54.120.000		949	0,03
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	9,820	27.02.2033		9.049.540		(341)	(0,01)
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	10,110	26.11.2025		9.311.000		(60)	0,00
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	10,130	25.01.2028		42.970.500		898	0,03

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits-datum		Nenn-betrag		Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	10,400 %	21.11.2029	COP	4.122.900	$	(141)	(0,01)
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	10,500	21.03.2025		194.830.310		615	0,02
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	10,990	21.11.2025		16.209.500		(178)	(0,01)
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	11,030	21.11.2025		15.885.200		(178)	(0,01)
Erhalt	3-Month ILS-TELBOR	3,210	17.06.2025	ILS	7.100		60	0,00
Erhalt	3-Month ILS-TELBOR	3,590	18.05.2028		30.500		(19)	0,00
Zahlung	3-Month KRW-KORIBOR	2,665	15.03.2028	KRW	15.946.900		(104)	0,00
Zahlung	3-Month KRW-KORIBOR	3,250	15.03.2033		82.062.061		(719)	(0,03)
Zahlung	3-Month THB-THORON Compounded-OIS	2,250	15.03.2028	THB	3.347.720		22	0,00
Erhalt	3-Month ZAR-JIBAR	6,635	04.02.2027	ZAR	53.800		28	0,00
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	7,120	26.05.2030		88.500		(411)	(0,01)
Erhalt	3-Month ZAR-JIBAR	7,205	22.04.2027		178.200		412	0,02
Erhalt	3-Month ZAR-JIBAR	7,210	22.04.2027		137.000		315	0,01
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	7,250	19.09.2023		142.300		(608)	(0,02)
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	7,460	06.03.2030		107.650		(40)	0,00
Erhalt	3-Month ZAR-JIBAR	7,565	22.03.2026		300.200		340	0,01
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	8,030	04.01.2028		152.000		(174)	(0,01)
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	8,120	13.03.2028		4.890		(5)	0,00
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	8,276	28.02.2028		263.600		(199)	(0,01)
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	8,830	23.02.2030		78.400		(44)	0,00
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	9,290	26.05.2028		335.100		327	0,01
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	9,350	18.05.2028		139.300		210	0,01
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	10,150	18.05.2033		121.800		253	0,01
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	2,080	01.06.2030	CLP	3.688.000		(207)	(0,01)
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	2,110	01.06.2030		1.385.000		(76)	0,00
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	3,000	07.01.2030		4.970.000		(705)	(0,02)
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	3,060	08.01.2030		4.500.000		(648)	(0,02)
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	3,120	05.02.2030		1.679.000		(222)	(0,01)
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	3,215	14.01.2030		9.767.400		1.443	0,05
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	3,420	01.09.2030		1.005.150		124	0,01
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	3,725	19.07.2028		2.502.900		316	0,01
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	3,731	20.07.2028		13.716.000		1.727	0,06
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	3,920	06.08.2028		9.384.500		1.032	0,04
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	3,990	06.07.2028		5.482.000		623	0,02
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	4,000	06.07.2028		2.901.000		322	0,01
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	4,410	01.09.2030		2.839.400		219	0,01
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	4,870	01.10.2028		3.460.000		(137)	0,00
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	5,015	13.09.2028		1.869.500		(67)	0,00
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	5,030	13.09.2028		6.500.000		(226)	(0,01)
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	5,030	20.03.2033		14.730.340		370	0,01
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	5,180	01.10.2028		1.905.000		36	0,00
Erhalt[3]	6-Month CLP-CHILIBOR	5,220	01.10.2028		4.896.800		(7)	0,00
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	5,240	01.09.2030		3.103.000		35	0,00
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	5,250	01.10.2028		7.411.400		124	0,01
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	5,300	18.05.2033		5.292.000		(76)	0,00
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	5,360	18.05.2033		2.594.000		(53)	0,00
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	5,370	01.10.2028		1.735.700		13	0,00
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	5,400	01.10.2028		949.000		4	0,00
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	5,420	01.10.2028		2.094.000		10	0,00
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	5,460	01.10.2028		952.100		(1)	0,00
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	5,550	05.06.2028		13.690.000		(149)	(0,01)
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	5,570	01.10.2028		1.925.000		(8)	0,00
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	5,620	01.10.2028		8.700.000		49	0,00
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	5,680	01.10.2028		2.490.200		(27)	0,00
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	5,820	01.09.2030		1.514.470		(55)	0,00
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	5,890	17.03.2032		1.533.000		(88)	0,00
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	5,930	17.03.2032		1.533.100		(88)	0,00
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	6,000	01.10.2028		5.006.600		143	0,01
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	6,010	16.02.2029		2.164.000		61	0,00
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	6,020	02.03.2029		1.250.400		41	0,00
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	6,100	01.04.2032		1.225.000		(94)	0,00
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	6,115	01.04.2032		1.273.000		(102)	0,00
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	6,250	01.10.2028		1.580.100		74	0,00
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	6,370	29.06.2029		4.532.000		356	0,01
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	6,420	24.03.2029		1.107.000		70	0,00
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	6,470	01.10.2028		3.085.000		(180)	(0,01)
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	6,500	01.10.2028		2.650.000		(160)	(0,01)
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	6,550	15.06.2032		2.352.600		314	0,01
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	6,580	01.10.2028		3.089.700		(201)	(0,01)
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	6,590	16.06.2032		6.916.000		951	0,03
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	6,610	17.06.2032		2.813.000		394	0,01
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	6,640	01.10.2028		1.614.000		(113)	0,00
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	6,650	01.10.2028		3.129.000		(217)	(0,01)
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	7,090	22.07.2029		7.495.700		(776)	(0,03)
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	7,160	01.10.2028		2.439.300		244	0,01
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	7,195	01.10.2028		1.355.100		141	0,01
Zahlung	6-Month CZK-PRIBOR	4,611	06.06.2028	CZK	3.476.300		(515)	(0,02)
Zahlung[3]	6-Month EUR-EURIBOR	3,000	20.09.2033	€	2.700		(15)	0,00
Erhalt[3]	6-Month EUR-EURIBOR	3,500	20.09.2025		25.200		191	0,01
Zahlung	6-Month HUF-BBR	1,500	19.06.2024	HUF	5.281.500		(1.430)	(0,05)
Zahlung	6-Month HUF-BBR	1,760	21.01.2030		1.296.900		(115)	0,00
Zahlung	6-Month HUF-BBR	2,420	02.08.2026		3.964.700		(2.421)	(0,09)

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits-datum		Nenn-betrag		Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Zahlung	6-Month HUF-BBR	2,680 %	29.06.2031	HUF	1.938.800	$	(1.104)	(0,04)
Zahlung	6-Month HUF-BBR	4,790	17.01.2027		7.857.000		(3.353)	(0,12)
Erhalt	6-Month HUF-BBR	8,500	17.01.2028		711.800		26	0,00
Zahlung	6-Month HUF-BBR	8,670	23.05.2029		1.828.200		267	0,01
Erhalt	6-Month HUF-BBR	8,700	16.01.2028		1.002.200		14	0,00
Erhalt	6-Month HUF-BBR	8,740	28.04.2028		1.920.800		(124)	0,00
Zahlung	6-Month HUF-BBR	9,230	26.08.2032		1.440.400		683	0,03
Zahlung	6-Month PLN-WIBOR	0,925	16.10.2030	PLN	1.500		(57)	0,00
Zahlung	6-Month PLN-WIBOR	1,163	03.12.2030		3.800		(145)	(0,01)
Zahlung	6-Month PLN-WIBOR	1,460	28.05.2026		44.900		(1.177)	(0,04)
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR	1,490	29.08.2029		57.400		2.224	0,08
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR	2,585	14.10.2029		15.200		371	0,01
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR	2,920	13.12.2031		3.800		119	0,01
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR	4,075	07.03.2027		37.000		408	0,02
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR	5,220	20.03.2033		14.100		(33)	0,00
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR	5,310	21.03.2033		40.800		(166)	(0,01)
Zahlung	6-Month PLN-WIBOR	5,520	20.03.2026		107.500		(33)	0,00
Zahlung	6-Month PLN-WIBOR	5,620	21.03.2026		115.400		47	0,00
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR	5,870	22.04.2027		1.000		(6)	0,00
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR	5,960	25.04.2027		67.900		(435)	(0,01)
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR	6,456	25.05.2027		40.800		(456)	(0,02)
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR	6,480	25.05.2027		45.100		(513)	(0,02)
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR	6,560	25.05.2027		15.800		(191)	(0,01)
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR	6,830	19.08.2024		52.600		(502)	(0,02)
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR	6,890	22.08.2024		119.500		(1.171)	(0,04)
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR	7,310	30.06.2027		15.300		(292)	(0,01)
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	6,540	31.05.2040	MXN	240.300		644	0,02
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	8,035	31.05.2029		83.200		52	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	8,207	19.06.2028		713.900		(233)	(0,01)
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	8,300	16.06.2028		361.200		(45)	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	9,335	02.08.2023		1.952.800		387	0,01
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	9,500	03.07.2023		3.190.100		(300)	(0,01)
						$	(16.541)	(0,59)
Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate						**$**	**(16.553)**	**(0,59)**

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

(2) Der maximal mögliche Betrag, den der Fonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

(3) Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft.

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

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

OPTIONSKAUF

DEVISENOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung		Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag(1)		Kosten		Markt-wert	% des Nettovermögens
BOA	Put - OTC EUR versus CZK	CZK	23,830	01.11.2023	2.091	$	228	$	928	0,03
	Call - OTC USD versus INR	INR	92,600	16.06.2025	2.200		132		19	0,00
	Put - OTC USD versus INR		92,600	16.06.2025	2.200		132		194	0,01
GLM	Put - OTC EUR versus HUF	HUF	385,000	01.11.2023	788		105		476	0,02
	Put - OTC EUR versus PLN	PLN	4,560	01.11.2023	1.575		188		1.238	0,05
JPM	Put - OTC EUR versus HUF	HUF	385,000	01.11.2023	1.581		151		954	0,03
	Put - OTC EUR versus PLN	PLN	4,560	01.11.2023	535		89		421	0,02
MYI	Put - OTC EUR versus CZK	CZK	23,830	01.11.2023	687		410		305	0,01
	Put - OTC EUR versus HUF	HUF	385,000	01.11.2023	606		225		366	0,01
	Put - OTC USD versus BRL	BRL	4,820	22.08.2023	26.361		281		394	0,01
	Put - OTC USD versus MXN	MXN	18,500	25.07.2023	25.738		647		1.907	0,07
RBC	Put - OTC USD versus CAD	CAD	1,305	13.07.2023	25.584		114		16	0,00
UAG	Call - OTC EUR versus USD	$	1,140	13.07.2023	23.246		146		0	0,00
	Call - OTC USD versus ZAR	ZAR	20,500	09.10.2023	40.134		559		407	0,02
						$	3.407	$	7.625	0,28

STRADDLE-OPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungs-kurs(2)	Verfalls-datum	Nenn-betrag(1)		Kosten(2)		Markt-wert	% des Nettovermögens
BOA	Call & Put - OTC 6-Month vs. 6-Month Forward Volatility Agreement	12,600 %	27.12.2023	17.100	$	0	$	4	0,00
	Call & Put - OTC 6-Month vs. 6-Month Forward Volatility Agreement	15,050	27.12.2023	17.100		0		18	0,00
CBK	Call & Put - OTC 6-Month vs. 6-Month Forward Volatility Agreement	15,100	20.12.2023	51.900		0		9	0,00
	Call & Put - OTC 6-Month vs. 6-Month Forward Volatility Agreement	12,600	29.12.2023	15.800		0		1	0,00
MYI	Call & Put - OTC 6-Month vs. 6-Month Forward Volatility Agreement	12,600	27.12.2023	23.800		0		5	0,00
					$	0	$	37	0,00

VERKAUFSOPTIONEN

DEVISENOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung		Ausübungskurs	Verfallsdatum	Nennbetrag[1]	Aufgeld	Marktwert	% des Nettovermögens
JPM	Call - OTC USD versus INR	IDR	14.950,000	06.06.2024	7.776	$ (263)	$ (276)	(0,01)
	Put - OTC USD versus INR		14.950,000	06.06.2024	7.776	(238)	(197)	(0,01)
MYI	Call - OTC USD versus CLP	CLP	850,000	18.07.2023	14.860	(211)	(20)	0,00
	Put - OTC USD versus MXN	MXN	17,750	25.07.2023	51.476	(329)	(1.677)	(0,05)
	Call - OTC USD versus MXN		21,000	07.03.2024	22.599	(504)	(159)	(0,01)
						$ (1.545)	$ (2.329)	(0,08)

ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungskurs	Verfallsdatum	Nennbetrag[1]	Aufgeld	Marktwert	% des Nettovermögens
BOA	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,380 %	31.07.2023	4.800	$ (19)	$ (23)	(0,01)
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,780	31.07.2023	4.800	(19)	(14)	0,00
BRC	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,260	26.07.2023	3.000	(10)	(6)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,660	26.07.2023	3.000	(10)	(15)	0,00
	Call - OTC 7-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,350	27.07.2023	2.700	(6)	(5)	0,00
	Put - OTC 7-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,850	27.07.2023	2.700	(6)	(10)	0,00
GLM	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,260	26.07.2023	2.600	(9)	(5)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,660	26.07.2023	2.600	(8)	(13)	0,00
	Call - OTC 7-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,350	27.07.2023	1.800	(4)	(3)	0,00
	Put - OTC 7-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,850	27.07.2023	1.800	(4)	(6)	0,00
MYC	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,270	24.07.2023	4.200	(14)	(8)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,670	24.07.2023	4.200	(14)	(17)	0,00
							$ (123)	$ (125)	(0,01)

(1) Der Nennbetrag stellt die Anzahl der Kontrakte dar.

(2) Ausübungskurs und endgültige Kosten werden zu einem zukünftigen Zeitpunkt auf der Basis impliziter Volatilitätsparameter festgelegt.

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMMISSIONEN - SCHUTZKAUF[1]

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu bezahlender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag[3]	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Marktwert	% des Nettovermögens
BOA	Turkey Government International Bond	(1,000) %	20.06.2024	$ 8.200	$ 486	$ (325)	$ 161	0,01
BPS	Turkey Government International Bond	(1,000)	20.06.2024	3.000	162	(103)	59	0,00
BRC	Turkey Government International Bond	(1,000)	20.06.2024	3.200	136	(73)	63	0,00
CBK	Turkey Government International Bond	(1,000)	20.06.2024	3.800	158	(83)	75	0,00
	Turkey Government International Bond	(1,000)	20.12.2024	2.700	165	(60)	105	0,01
GST	Turkey Government International Bond	(1,000)	20.06.2024	29.700	1.409	(826)	583	0,02
					$ 2.516	$ (1.470)	$ 1.046	0,04

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMMISSIONEN - SCHUTZVERKAUF[2]

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag[3]	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Marktwert	% des Nettovermögens
BPS	Poland Government International Bond	1,000 %	20.12.2023	$ 500	$ 2	$ 0	$ 2	0,00
	South Africa Government International Bond	1,000	20.12.2023	1.800	(3)	6	3	0,00
CBK	Petroleos Mexicanos	1,000	20.06.2024	12.000	(371)	149	(222)	(0,01)
DUB	Eskom Holdings SOC Ltd.	4,650	30.06.2029	11.200	0	348	348	0,01
GST	Poland Government International Bond	1,000	20.12.2023	1.200	4	1	5	0,00
	Poland Government International Bond	1,000	20.06.2024	3.400	15	10	25	0,00
JPM	Banco do Brasil S.A.	1,000	20.12.2024	6.500	(146)	93	(53)	0,00
					$ (499)	$ 607	$ 108	0,00

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

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

(3) Der maximal mögliche Betrag, den der Fonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

CROSS-CURRENCY SWAPS

Kontrahent	Erhalt	Zahlung	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag erhaltener Währung	Nennbetrag gelieferter Währung	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Marktwert	% des Nettovermögens
GLM	Variabler Zinssatz entspricht 6-Month USD-LIBOR zzgl. 0,330 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung	Variabler Zinssatz entspricht 6-Month ARS-LIBOR basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung	28.05.2024	USD 1.900	ARS 85.633	$ 0	$ 1.816	$ 1.816	0,06
	Variabler Zinssatz entspricht 6-Month USD-LIBOR zzgl. 0,333 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung	Variabler Zinssatz entspricht 6-Month ARS-LIBOR basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung	30.05.2024	4.820	214.249	(15)	4.627	4.612	0,17
	Variabler Zinssatz entspricht 6-Month USD-LIBOR zzgl. 0,282 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung	Variabler Zinssatz entspricht 6-Month ARS-LIBOR basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung	07.06.2027	2.090	93.789	(3)	2.037	2.034	0,07
						$ (18)	$ 8.480	$ 8.462	0,30

ZINSSWAPS

Kontrahent	Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeitsdatum		Nennbetrag	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Marktwert	% des Nettovermögens
BOA	Zahlung	3-Month ILS-TELBOR	0,680 %	08.09.2030	ILS	44.500	$ 0	$ (2.181)	$ (2.181)	(0,08)
	Erhalt	3-Month ILS-TELBOR	0,800	24.04.2028		120.000	0	4.315	4.315	0,15
	Zahlung	3-Month ILS-TELBOR	1,963	16.02.2028		21.300	0	(412)	(412)	(0,01)
	Zahlung	3-Month ILS-TELBOR	1,998	20.06.2028		13.700	0	(282)	(282)	(0,01)
	Erhalt	3-Month MYR-KLIBOR	3,500	15.03.2028	MYR	161.119	196	43	239	0,01
	Zahlung	3-Month MYR-KLIBOR	3,500	15.03.2028		33.100	10	(59)	(49)	0,00
	Erhalt	3-Month MYR-KLIBOR	3,750	15.03.2028		30.420	(91)	64	(27)	0,00
BRC	Erhalt	3-Month ILS-TELBOR	0,795	20.06.2028	ILS	32.000	0	1.123	1.123	0,04
	Zahlung	3-Month ILS-TELBOR	1,950	20.06.2028		34.500	0	(730)	(730)	(0,03)
BSH	Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	3,300	21.06.2029	CLP	3.450.000	0	416	416	0,01
	Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	3,750	22.03.2026		8.000.000	0	(772)	(772)	(0,03)
	Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	3,790	14.03.2026		3.885.000	7	(384)	(377)	(0,01)
CBK	Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	5,960	10.05.2029	COP	27.236.900	0	501	501	0,02
	Erhalt	3-Month ILS-TELBOR	0,485	09.08.2024	ILS	68.500	0	886	886	0,03
	Erhalt	3-Month ILS-TELBOR	0,950	23.05.2024		122.500	0	1.258	1.258	0,05
	Zahlung	3-Month ILS-TELBOR	1,041	15.05.2024		101.800	0	(1.013)	(1.013)	(0,04)
	Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	3,763	24.05.2029	CLP	1.841.700	10	(192)	(182)	(0,01)
	Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	3,770	19.03.2026		64.800	0	(6)	(6)	0,00
CKL	Zahlung	3-Month ILS-TELBOR	2,100	20.06.2028	ILS	14.000	(46)	(225)	(271)	(0,01)
DUB	Erhalt	3-Month ILS-TELBOR	0,690	27.09.2027		20.100	0	611	611	0,02
GLM	Erhalt	1-Year BRL-CDI	11,708	02.01.2025	BRL	18.800	0	(4)	(4)	0,00
	Erhalt	3-Month ILS-TELBOR	0,520	12.08.2024	ILS	93.500	0	1.192	1.192	0,04
	Zahlung	3-Month ILS-TELBOR	0,540	11.05.2027		11.600	0	(376)	(376)	(0,01)
	Erhalt	3-Month ILS-TELBOR	0,720	20.06.2028		8.800	0	317	317	0,01
	Erhalt	3-Month ILS-TELBOR	0,820	15.01.2030		43.800	0	1.976	1.976	0,07
	Erhalt	3-Month ILS-TELBOR	0,950	23.05.2024		75.700	0	777	777	0,03
	Erhalt	3-Month ILS-TELBOR	0,960	24.05.2024		70.700	0	724	724	0,03
	Zahlung	3-Month ILS-TELBOR	1,048	27.02.2024		132.400	0	(925)	(925)	(0,03)
	Zahlung	3-Month ILS-TELBOR	1,883	21.03.2028		28.100	0	(558)	(558)	(0,02)
	Zahlung	3-Month ILS-TELBOR	1,898	17.12.2025		57.400	0	(673)	(673)	(0,02)
	Zahlung	3-Month ILS-TELBOR	1,971	16.02.2028		43.600	0	(838)	(838)	(0,03)
	Zahlung	3-Month ILS-TELBOR	1,998	20.06.2028		28.300	0	(583)	(583)	(0,02)
	Erhalt	3-Month MYR-KLIBOR	3,545	05.05.2028	MYR	118.027	0	139	139	0,01
	Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	2,990	01.08.2029	CLP	2.813.100	0	(514)	(514)	(0,02)
	Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	3,015	20.06.2026		5.555.000	0	554	554	0,02
	Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	3,265	14.06.2029		4.122.200	0	(518)	(518)	(0,02)
	Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	3,830	22.05.2029		7.729.900	0	(735)	(735)	(0,03)
	Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	4,095	01.06.2027		12.230.000	0	(847)	(847)	(0,03)
	Zahlung[1]	6-Month CLP-CHILIBOR	4,319	22.05.2029		19.808.000	0	(98)	(98)	0,00
GST	Erhalt	3-Month MYR-KLIBOR	3,500	15.03.2028	MYR	89.615	88	45	133	0,00
HUS	Zahlung	3-Month ILS-TELBOR	1,018	11.03.2024	ILS	82.600	0	(581)	(581)	(0,02)
	Zahlung	3-Month ILS-TELBOR	1,018	15.05.2024		91.500	0	(916)	(916)	(0,03)
	Zahlung	3-Month ILS-TELBOR	1,998	20.06.2028		14.900	1	(308)	(307)	(0,01)
JPM	Erhalt	3-Month ILS-TELBOR	0,475	09.08.2024		71.500	0	929	929	0,03
	Erhalt	3-Month ILS-TELBOR	0,813	20.06.2028		18.100	0	631	631	0,02
	Zahlung	3-Month ILS-TELBOR	1,027	19.03.2024		37.000	0	(259)	(259)	(0,01)
	Zahlung	3-Month ILS-TELBOR	1,095	10.05.2024	ILS	19.800	0	(195)	(195)	(0,01)
	Zahlung	3-Month ILS-TELBOR	2,078	20.06.2028		12.600	0	(247)	(247)	(0,01)
	Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	3,540	04.06.2029	CLP	4.115.000	0	452	452	0,02
MYC	Zahlung	1-Year BRL-CDI	7,800	04.01.2027	BRL	12.200	17	(110)	(93)	0,00
							$ 192	$ 1.412	$ 1.604	0,06

[1] Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft.

DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung		Zu erhaltende Währung		Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2023	CZK	125.274	$	5.826	$ 77	$ 0	$ 77	0,00
	07.2023	KES	473.310		3.342	0	(7)	(7)	0,00
	07.2023	PLN	2.247		528	0	(25)	(25)	0,00
	07.2023	$	1.659	£	1.312	9	0	9	0,00
	07.2023		5.669	ILS	20.612	0	(111)	(111)	0,00
	07.2023		1.298	MXN	23.891	92	0	92	0,00
	07.2023		594	PEN	2.180	6	0	6	0,00
	07.2023		7.001	PLN	29.115	160	0	160	0,01
	08.2023	€	2.796	$	3.071	15	0	15	0,00
	08.2023	MXN	165.419		8.949	0	(622)	(622)	(0,02)
	08.2023	NZD	7.024		4.454	152	0	152	0,01
	08.2023	$	242	AUD	358	0	(3)	(3)	0,00
	08.2023		18.929	CNY	129.905	0	(957)	(957)	(0,03)
	08.2023		711	EGP	23.675	32	0	32	0,00
	08.2023		9.345	€	8.600	57	0	57	0,00
	08.2023		0	ZAR	2	0	0	0	0,00
	09.2023	CLP	3.996.762	$	4.808	0	(131)	(131)	0,00
	09.2023	NGN	310.612		536	143	0	143	0,01
	09.2023	TWD	58.910		1.941	45	0	45	0,00
	09.2023	$	3.878	CLP	3.114.965	0	(31)	(31)	0,00
	09.2023		236	HKD	1.848	0	0	0	0,00
	09.2023		96	KRW	121.984	0	(3)	(3)	0,00
	09.2023		13.217	MYR	60.532	0	(182)	(182)	(0,01)
	09.2023		53	NGN	41.128	0	(1)	(1)	0,00
	09.2023		40.443	THB	1.402.760	0	(580)	(580)	(0,02)
	10.2023		897	KES	134.789	33	0	33	0,00
	10.2023	ZAR	105.882	$	5.706	156	0	156	0,01
	11.2023	€	12.909	CZK	315.220	245	0	245	0,01
	03.2030	$	12.534	IDR	246.110.438	1.797	0	1.797	0,07
BPS	07.2023	BRL	101.355	$	20.567	66	(510)	(444)	(0,02)
	07.2023	CZK	26.475		1.229	14	0	14	0,00
	07.2023	MYR	43.807		9.544	141	0	141	0,01
	07.2023	PEN	7.872		2.159	0	(12)	(12)	0,00
	07.2023	PHP	174.925		3.103	0	(59)	(59)	0,00
	07.2023	PLN	20.360		4.922	0	(85)	(85)	0,00
	07.2023	$	13.755	BRL	68.601	466	0	466	0,02
	07.2023		7.752	COP	35.048.976	607	0	607	0,02
	07.2023		21.767	CZK	468.215	0	(281)	(281)	(0,01)
	07.2023		128	€	118	0	0	0	0,00
	07.2023		3.345	£	2.610	0	(26)	(26)	0,00
	07.2023		2.914	¥	405.017	0	(112)	(112)	0,00
	07.2023		80.003	MXN	1.400.000	1.485	0	1.485	0,05
	07.2023		1.076	PEN	3.936	10	0	10	0,00
	07.2023		9.270	PHP	519.318	118	0	118	0,00
	07.2023		3.416	RON	15.889	77	0	77	0,00
	08.2023	€	346	$	380	1	0	1	0,00
	08.2023	MYR	146.625		31.563	54	0	54	0,00
	08.2023	TWD	29.486		966	19	0	19	0,00
	08.2023	$	13.886	CLP	11.459.287	349	0	349	0,01
	08.2023		8.445	CNH	58.352	0	(397)	(397)	(0,01)
	08.2023		44.289	CNY	304.030	0	(2.227)	(2.227)	(0,08)
	08.2023		10.280	COP	46.160.753	680	0	680	0,02
	08.2023		22.696	€	20.732	0	(30)	(30)	0,00
	08.2023		24.766	ZAR	460.891	0	(468)	(468)	(0,02)
	09.2023	PHP	1.115.619	$	19.879	0	(254)	(254)	(0,01)
	09.2023	$	3.083	COP	13.088.753	0	(12)	(12)	0,00
	09.2023		2.737	INR	225.096	0	(1)	(1)	0,00
	09.2023		388	PEN	1.420	1	0	1	0,00
	09.2023		3.571	THB	122.766	0	(82)	(82)	0,00
	09.2023		2.362	ZAR	43.590	0	(71)	(71)	0,00
	11.2023	€	8.500	CZK	203.104	0	(43)	(43)	0,00
	11.2023	ILS	31.394	$	9.118	602	0	602	0,02
	12.2023	MXN	60.314		3.383	0	(29)	(29)	0,00
	12.2023	NGN	93.960		116	1	0	1	0,00
	01.2024	$	1.147	EGP	37.804	0	(113)	(113)	0,00
BRC	07.2023	PLN	2.455	$	588	0	(16)	(16)	0,00
	07.2023	RON	74.292		16.131	0	(205)	(205)	(0,01)
	07.2023	$	5.806	CZK	124.241	0	(104)	(104)	0,00
	07.2023	$	30.460	MYR	139.753	0	(462)	(462)	(0,02)
	07.2023		2.992	PLN	12.588	104	0	104	0,00
	07.2023		3.882	RON	17.366	0	(63)	(63)	0,00
	08.2023	CNH	14.135	$	1.994	44	0	44	0,00
	08.2023	COP	113.470.437		26.635	0	(204)	(204)	(0,01)
	08.2023	$	393	CNH	2.804	0	(6)	(6)	0,00
	08.2023		387	HUF	133.232	0	(3)	(3)	0,00
	08.2023		30.171	ZAR	557.665	0	(772)	(772)	(0,03)
	08.2023	ZAR	5.472	$	285	0	(4)	(4)	0,00
	09.2023	ILS	8.181		2.290	79	0	79	0,00
	09.2023	MXN	168.876		9.674	0	(30)	(30)	0,00
	09.2023	$	1.958	ILS	7.088	0	(42)	(42)	0,00
	09.2023		2.389	PEN	8.763	14	0	14	0,00

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung		Zu erhaltende Währung		Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
	09.2023	ZAR	1.341.373	$	75.949	$ 5.434	$ 0	$ 5.434	0,20
	10.2023	TRY	2.584		95	0	0	0	0,00
BSH	07.2023	$	2.380	PEN	8.760	36	0	36	0,00
	08.2023	PEN	7.590	$	1.898	0	(188)	(188)	(0,01)
CBK	07.2023	CLP	19.046.146		23.534	0	(184)	(184)	(0,01)
	07.2023	ILS	20.463		5.930	412	0	412	0,02
	07.2023	MXN	36.301		2.098	2	(17)	(15)	0,00
	07.2023	PEN	112.191		30.195	0	(756)	(756)	(0,03)
	07.2023	PHP	218.419		4.004	55	0	55	0,00
	07.2023	PLN	70.879		16.963	0	(468)	(468)	(0,02)
	07.2023	$	7.410	BRL	35.573	0	(36)	(36)	0,00
	07.2023		6.785	COP	30.960.559	584	0	584	0,02
	07.2023		21.326	CZK	460.457	17	(213)	(196)	(0,01)
	07.2023		4.787	EGP	90.000	0	(1.875)	(1.875)	(0,07)
	07.2023		34.279	PEN	124.593	90	0	90	0,00
	07.2023		5.581	PLN	23.178	119	0	119	0,00
	07.2023		4.797	RON	21.689	0	(28)	(28)	0,00
	07.2023		3.580	UYU	134.341	14	0	14	0,00
	07.2023	UYU	279.852	$	7.223	0	(247)	(247)	(0,01)
	08.2023	CAD	1.982		1.487	0	(12)	(12)	0,00
	08.2023	CLP	11.459.287		13.831	0	(403)	(403)	(0,01)
	08.2023	COP	23.471.460		5.551	1	(2)	(1)	0,00
	08.2023	EGP	63.401		1.829	0	(161)	(161)	(0,01)
	08.2023	€	354		381	0	(6)	(6)	0,00
	08.2023	TWD	30.699		1.006	20	0	20	0,00
	08.2023	$	3.025	BRL	15.357	143	0	143	0,01
	08.2023		71	CNH	494	0	(3)	(3)	0,00
	08.2023		6.561	€	6.027	42	(14)	28	0,00
	08.2023		236	MXN	4.084	1	0	1	0,00
	08.2023		780	NOK	8.133	0	(19)	(19)	0,00
	08.2023		2.212	PEN	8.641	163	0	163	0,01
	08.2023	ZAR	197	$	11	0	0	0	0,00
	09.2023	COP	4.980.182		1.179	11	0	11	0,00
	09.2023	MXN	146.059		7.841	0	(544)	(544)	(0,02)
	09.2023	PEN	8.040		2.185	0	(20)	(20)	0,00
	09.2023	PHP	617.053		10.952	0	(184)	(184)	(0,01)
	09.2023	$	53.514	IDR	798.768.556	0	(456)	(456)	(0,02)
	09.2023		24.941	INR	2.067.098	185	0	185	0,01
	09.2023		18.721	PEN	68.649	104	0	104	0,00
	09.2023		6.527	ZAR	119.974	5	(225)	(220)	(0,01)
	09.2023	ZMW	77.599	$	4.421	90	0	90	0,00
	10.2023	$	52.467	CLP	43.001.960	497	0	497	0,02
	10.2023		600	NGN	358.822	0	(155)	(155)	(0,01)
	11.2023	ILS	37.683	$	11.421	1.199	0	1.199	0,04
	11.2023	$	181	EGP	5.845	0	(12)	(12)	0,00
	01.2024	EGP	29.698	$	807	0	(6)	(6)	0,00
	02.2024		34.798		926	0	(8)	(8)	0,00
	02.2024	$	3.165	EGP	110.308	0	(205)	(205)	(0,01)
DUB	07.2023	PEN	216.511	$	59.392	0	(323)	(323)	(0,01)
	07.2023	$	1	KES	118	0	0	0	0,00
	07.2023		29.598	PEN	108.256	267	0	267	0,01
	08.2023	ZAR	139.944	$	7.273	0	(105)	(105)	0,00
	09.2023	$	8.954	ZAR	166.316	119	(330)	(211)	(0,01)
	10.2023		1.500	NGN	885.347	0	(396)	(396)	(0,01)
	11.2023	EGP	14.282	$	501	89	0	89	0,00
	01.2024	NGN	384.375		625	166	0	166	0,01
	02.2024	$	8.159	EGP	286.732	0	(470)	(470)	(0,02)
	04.2024	TRY	2.282	$	73	1	0	1	0,00
GLM	07.2023	BRL	225.484		47.187	445	0	445	0,02
	07.2023	COP	21.842.485		4.960	0	(265)	(265)	(0,01)
	07.2023	DOP	1.298.081		22.428	0	(793)	(793)	(0,03)
	07.2023	EGP	287.714		10.325	1.198	(63)	1.135	0,04
	07.2023	PEN	15.492		4.242	0	(29)	(29)	0,00
	07.2023	$	21.535	BRL	113.559	2.006	0	2.006	0,07
	07.2023		7.456	COP	31.402.811	37	(6)	31	0,00
	07.2023		2.948	EGP	96.843	159	0	159	0,01
	07.2023		39.170	MXN	689.008	935	0	935	0,03
	07.2023		2.747	MYR	12.640	0	(34)	(34)	0,00
	07.2023		1.133	PLN	4.774	41	0	41	0,00
	07.2023		2.792	RON	12.594	0	(23)	(23)	0,00
	08.2023	CHF	180	$	204	1	0	1	0,00
	08.2023	CNH	297.572		42.456	1.417	0	1.417	0,05
	08.2023	DOP	1.545.785		27.240	40	(519)	(479)	(0,02)
	08.2023	$	65.744	BRL	321.506	1.015	(436)	579	0,02
	08.2023		2.665	CNH	18.408	0	(127)	(127)	0,00
	08.2023		343	NOK	3.637	0	(3)	(3)	0,00
	08.2023		1.847	PEN	6.739	6	0	6	0,00
	08.2023	ZAR	78.924	$	4.253	91	0	91	0,00

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung		Zu erhaltende Währung		Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
	09.2023	IDR	62.693.244		4.204	$ 40	$ 0	$ 40	0,00
	09.2023	TRY	225.925		8.834	447	0	447	0,02
	09.2023	$	165.474	BRL	833.635	5.416	0	5.416	0,19
	09.2023		2.395	PEN	8.810	20	0	20	0,00
	09.2023		27.685	THB	955.129	0	(543)	(543)	(0,02)
	10.2023	DOP	359.626	$	6.413	37	0	37	0,00
	10.2023	MXN	219.363		12.495	0	(48)	(48)	0,00
	10.2023	NGN	1.735.661		3.097	939	0	939	0,03
	11.2023	DOP	195.976		3.524	76	0	76	0,00
	11.2023	EGP	46.453		1.384	88	(43)	45	0,00
	11.2023	€	12.017	PLN	54.009	21	0	21	0,00
	11.2023	$	747	EGP	22.633	0	(94)	(94)	0,00
	12.2023	DOP	113.708	$	2.042	48	0	48	0,00
	01.2024	EGP	101.314		2.695	0	(78)	(78)	0,00
	01.2024	$	3.055	EGP	100.557	0	(303)	(303)	(0,01)
	01.2024	ZAR	160.293	$	9.119	792	0	792	0,03
HUS	07.2023	EGP	469.250		25.000	9.815	0	9.815	0,34
IND	07.2023	BRL	14.316	$	2.896	0	(72)	(72)	0,00
	08.2023	CNH	24.621		3.592	196	0	196	0,01
	08.2023	$	16.398	€	15.090	99	0	99	0,00
	08.2023		880	NOK	9.225	0	(18)	(18)	0,00
	09.2023	INR	270.939	$	3.296	3	0	3	0,00
	11.2023	€	1.739	HUF	805.467	384	0	384	0,01
	06.2024	$	7.206	TWD	185.403	0	(1.078)	(1.078)	(0,04)
JPM	07.2023	COP	13.055.307	$	2.820	0	(293)	(293)	(0,01)
	07.2023	¥	137.927		964	10	0	10	0,00
	07.2023	MXN	48.989		2.785	0	(66)	(66)	0,00
	07.2023	PHP	14.294		262	3	0	3	0,00
	07.2023	SGD	900		681	16	0	16	0,00
	07.2023	TRY	6.201		238	0	0	0	0,00
	07.2023	$	6.716	BRL	33.513	231	0	231	0,01
	07.2023		19.166	MXN	337.899	502	0	502	0,02
	07.2023		449	NGN	246.211	0	(130)	(130)	0,00
	07.2023		265	PLN	1.123	11	0	11	0,00
	07.2023		43.121	RON	195.728	0	(84)	(84)	0,00
	08.2023	CAD	3.259	$	2.437	0	(27)	(27)	0,00
	08.2023	CHF	2.913		3.248	4	(26)	(22)	0,00
	08.2023	COP	13.510.737		3.186	0	(22)	(22)	0,00
	08.2023	HUF	9.918.868		28.660	159	(153)	6	0,00
	08.2023	MXN	164.219		9.478	0	(20)	(20)	0,00
	08.2023	$	44.975	CNY	307.975	0	(2.367)	(2.367)	(0,08)
	08.2023		1.187	EGP	39.726	60	0	60	0,00
	08.2023		210	HUF	71.949	0	(2)	(2)	0,00
	08.2023		964	¥	137.341	0	(10)	(10)	0,00
	08.2023		126	NOK	1.341	0	(1)	(1)	0,00
	08.2023		448	UYU	17.593	18	0	18	0,00
	08.2023		4.345	ZAR	79.525	0	(152)	(152)	(0,01)
	08.2023	UYU	19.861	$	500	0	(27)	(27)	0,00
	08.2023	ZAR	185.903		9.566	0	(234)	(234)	(0,01)
	09.2023	COP	2.248.074		532	5	0	5	0,00
	09.2023	IDR	26.138.902		1.741	4	0	4	0,00
	09.2023	ILS	6.826		1.922	77	0	77	0,00
	09.2023	TRY	56.193		2.114	38	0	38	0,00
	09.2023	$	6.361	INR	523.313	0	0	0	0,00
	09.2023		454	NGN	269.621	0	(113)	(113)	0,00
	09.2023		3.847	THB	132.152	0	(91)	(91)	0,00
	09.2023		11.931	ZAR	233.721	355	0	355	0,01
	10.2023		793	NGN	491.213	0	(184)	(184)	(0,01)
	11.2023	HUF	806.200	€	1.739	0	(387)	(387)	(0,01)
	12.2023	NGN	421.659	$	679	165	0	165	0,01
	12.2023	$	815	NGN	514.954	0	(186)	(186)	(0,01)
	01.2024	EGP	39.488	$	1.071	0	(10)	(10)	0,00
	01.2024	$	499	EGP	16.406	0	(50)	(50)	0,00
	01.2024		82	NGN	67.814	0	(1)	(1)	0,00
	02.2024	EGP	50.142	$	1.323	0	(21)	(21)	0,00
	04.2024	KES	802.538		5.222	0	(77)	(77)	0,00
	04.2024	TRY	267.487		8.535	57	0	57	0,00
	04.2024	$	2.330	TRY	69.917	0	(114)	(114)	0,00
	06.2024		1.104	IDR	16.560.000	0	(9)	(9)	0,00
	03.2030	IDR	252.540.875	$	12.118	0	(2.587)	(2.587)	(0,09)
	03.2030	$	11.598	IDR	246.110.438	2.733	0	2.733	0,10
MBC	07.2023	£	7.874	$	9.747	0	(264)	(264)	(0,01)
	07.2023	SGD	29		22	1	0	1	0,00
	07.2023	$	1.486	KES	215.400	38	0	38	0,00
	07.2023		108.678	PLN	470.010	6.909	0	6.909	0,25
	08.2023	€	52.236	$	57.641	534	0	534	0,02
	08.2023	$	2.748	CNY	19.365	0	(69)	(69)	0,00
	08.2023		415	COP	1.874.001	30	0	30	0,00
	08.2023	ZAR	92.602	$	4.990	109	0	109	0,00
	09.2023	$	177	KRW	226.123	0	(5)	(5)	0,00
	09.2023		140	THB	4.821	0	(3)	(3)	0,00
	09.2023	ZAR	158.510	$	8.762	430	0	430	0,02
	11.2023	€	3.818	PLN	17.159	7	0	7	0,00
	01.2024	$	992	EGP	32.681	0	(98)	(98)	0,00
MYI	07.2023	CZK	23.199	$	1.085	20	0	20	0,00
	07.2023	MXN	90.006		4.996	0	(239)	(239)	(0,01)
	07.2023	PHP	111.680		1.986	0	(33)	(33)	0,00
	07.2023	PLN	2.385		553	0	(34)	(34)	0,00

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung		Zu erhaltende Währung		Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
	07.2023	TRY	222.191	$	8.925	$ 409	$ 0	$ 409	0,02
	07.2023	$	20.488	COP	86.379.722	67	0	67	0,00
	07.2023		3.798	CZK	81.879	0	(41)	(41)	0,00
	07.2023		25.730	EGP	568.058	0	(7.441)	(7.441)	(0,27)
	07.2023		341	MXN	5.968	7	0	7	0,00
	07.2023		11.260	MYR	51.947	4	(114)	(110)	0,00
	07.2023		1.916	PLN	8.066	68	0	68	0,00
	08.2023	€	12.185	$	13.211	0	(110)	(110)	0,00
	08.2023	TWD	75.619		2.486	57	0	57	0,00
	08.2023	$	8.797	€	8.123	84	0	84	0,00
	08.2023		28	ZAR	520	0	(1)	(1)	0,00
	08.2023	ZAR	302.031	$	15.699	0	(223)	(223)	(0,01)
	09.2023	AED	29.573		8.052	0	0	0	0,00
	09.2023	IDR	40.511.883		2.720	29	0	29	0,00
	09.2023	TRY	184.140		6.897	12	0	12	0,00
	09.2023	$	5.784	IDR	86.351.356	0	(48)	(48)	0,00
	09.2023		253	ILS	906	0	(8)	(8)	0,00
	09.2023		199	KRW	254.127	0	(5)	(5)	0,00
	09.2023		23.034	THB	791.300	0	(548)	(548)	(0,02)
	09.2023		26.211	ZAR	497.154	417	(493)	(76)	0,00
	10.2023	CLP	21.830.145	$	26.202	0	(685)	(685)	(0,02)
	10.2023	ZAR	2.449		132	4	0	4	0,00
	11.2023	CZK	203.201	€	8.500	38	0	38	0,00
	11.2023	EGP	69.353	$	1.977	0	(20)	(20)	0,00
	01.2024	NGN	317.955		517	137	0	137	0,01
	01.2024	$	3.143	EGP	105.605	0	(269)	(269)	(0,01)
	02.2024	EGP	21.106	$	563	0	(3)	(3)	0,00
RBC	07.2023	$	21.849	MXN	420.398	2.621	0	2.621	0,09
	07.2023		2.757	MYR	12.688	0	(34)	(34)	0,00
	08.2023	MXN	1.556.660	$	89.825	0	(209)	(209)	(0,01)
	08.2023	$	2.905	CAD	3.938	73	0	73	0,00
RYL	09.2023		11.222	ZAR	204.941	0	(449)	(449)	(0,02)
SCX	07.2023	€	27	$	29	0	0	0	0,00
	07.2023	MYR	32.159		6.997	94	0	94	0,00
	07.2023	NGN	300.933		571	181	0	181	0,01
	07.2023	$	72	NGN	55.296	0	0	0	0,00
	08.2023	MYR	32.370	$	6.970	14	0	14	0,00
	08.2023	NZD	2.493		1.556	29	0	29	0,00
	08.2023	TWD	34.602		1.133	22	0	22	0,00
	08.2023	$	3.875	BRL	18.906	25	0	25	0,00
	08.2023		19.267	CNH	132.430	0	(1.003)	(1.003)	(0,04)
	09.2023	TWD	49.300	$	1.617	31	0	31	0,00
	09.2023	$	12.605	INR	1.044.968	97	0	97	0,00
	09.2023		1.760	PEN	6.479	18	0	18	0,00
	09.2023		25.207	THB	877.904	0	(259)	(259)	(0,01)
	09.2023		2.166	TRY	49.406	0	(341)	(341)	(0,01)
	09.2023		2.457	ZAR	45.281	0	(77)	(77)	0,00
	10.2023	CLP	21.171.815	$	25.389	0	(688)	(688)	(0,02)
	11.2023	EGP	57.399		1.570	0	(83)	(83)	0,00
	11.2023	$	3.855	EGP	150.553	480	0	480	0,02
	12.2023		2.677	KES	393.738	9	0	9	0,00
	01.2024		1.039	EGP	34.170	0	(104)	(104)	0,00
	01.2024		854	NGN	701.988	0	(15)	(15)	0,00
	02.2024		2.221	EGP	77.297	0	(147)	(147)	(0,01)
	06.2024	KES	411.269	$	2.677	0	(7)	(7)	0,00
	03.2030	IDR	239.680.000		10.700	0	(3.257)	(3.257)	(0,12)
SOG	07.2023	$	2.568	KES	372.407	66	0	66	0,00
	09.2023		240	ZAR	4.538	0	(1)	(1)	0,00
	01.2024		1.697	EGP	55.237	0	(187)	(187)	(0,01)
SSB	07.2023		17.870	BRL	89.763	738	0	738	0,03
	07.2023		23.744	CLP	19.073.452	8	0	8	0,00
	07.2023		30.760	PEN	112.199	176	0	176	0,01
	08.2023	CLP	19.128.537	$	23.744	2	0	2	0,00
	08.2023	PEN	112.199		30.717	0	(158)	(158)	(0,01)
	09.2023	$	4.945	CLP	3.996.762	0	(6)	(6)	0,00
TOR	07.2023	COP	18.477.387	$	4.422	26	0	26	0,00
	07.2023	$	4.422	COP	18.327.934	0	(33)	(33)	0,00
	07.2023		110	CZK	2.354	0	(1)	(1)	0,00
	07.2023		5.022	£	3.952	3	0	3	0,00
	07.2023		38.286	PLN	162.267	1.619	0	1.619	0,06
	08.2023	£	3.952	$	5.023	0	(2)	(2)	0,00
	08.2023	$	281	ZAR	5.472	7	0	7	0,00
	08.2023	ZAR	138.447	$	7.324	26	0	26	0,00
	09.2023	$	2.385	ZAR	46.448	59	(2)	57	0,00
UAG	07.2023	COP	9.694.156	$	2.325	6	0	6	0,00
	07.2023	PLN	241.738		59.145	0	(304)	(304)	(0,01)
	07.2023	RON	163		35	0	0	0	0,00
	07.2023	$	269	CZK	5.856	2	(2)	0	0,00
	07.2023		5.412	MXN	96.367	199	0	199	0,01
	07.2023		2.083	PLN	8.500	7	0	7	0,00
	07.2023		2.663	TRY	61.353	0	(326)	(326)	(0,01)
	08.2023	HUF	1.310.754	$	3.761	0	(26)	(26)	0,00
	08.2023	$	17.186	CNY	118.222	0	(830)	(830)	(0,03)

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung		Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
	08.2023	$ 2.325	COP	9.768.548	$ 0	$ (5)	$ (5)	0,00
	08.2023	10	ZAR	196	0	0	0	0,00
	08.2023	ZAR 160.144	$	8.558	115	0	115	0,00
	09.2023	ILS 5.908		1.650	54	0	54	0,00
	09.2023	SGD 33.328		24.938	240	0	240	0,01
	09.2023	$ 2.722	THB	95.047	0	(21)	(21)	0,00
	09.2023	7.246	ZAR	128.361	0	(498)	(498)	(0,02)
	10.2023	5.838		107.241	0	(217)	(217)	(0,01)
	11.2023	CZK 316.478	€	12.958	0	(248)	(248)	(0,01)
	11.2023	ILS 6.376	$	1.844	114	0	114	0,00
	04.2024	$ 6.557	TRY	198.196	0	(275)	(275)	(0,01)
					$ 64.649	$ (50.035)	$ 14.614	0,52
Summe Freiverkehrsfinanzderivate							**$ 31.042**	**1,11**

BESCHREIBUNG		PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
EINLAGENZERTIFIKATE				
Banco Davivienda S.A.				
13,501 % fällig am 13.12.2024	COP	12.258.000	$ 2.935	0,10
15,389 % fällig am 21.02.2024		3.100.500	753	0,03
BanColombia S.A.				
5,917 % fällig am 27.01.2024		14.430.300	3.326	0,12
13,320 % fällig am 08.06.2025		6.362.000	1.529	0,05
13,637 % fällig am 14.12.2024		17.049.000	4.106	0,15
16,137 % fällig am 01.09.2024		6.849.000	1.659	0,06
BBVA Colombia S.A.				
5,870 % fällig am 15.07.2024		14.375.000	3.234	0,12
14,540 % fällig am 13.01.2024		6.028.200	1.432	0,05
16,412 % fällig am 25.04.2024		225.000	53	0,00
Summe Einlagenzertifikate			**$ 19.027**	**0,68**
Summe Anlagen			**$ 2.852.494**	**102,41**
Sonstige Aktiva und Passiva			**$ (67.051)**	**(2,41)**
Nettovermögen			**$ 2.785.443**	**100,00**

ERLÄUTERUNGEN ZUR AUFSTELLUNG DES WERTPAPIERBESTANDS (Angaben in Tausend*):

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

^ **Das Wertpapier ist in Verzug.**

(a) **Bei dem Wertpapier handelt es sich um ein Interest Only- („IO“) bzw. IO-Strip.**

(b) **Wertpapier mit Sachwertausschüttung.**

(c) **Das Wertpapier hat in den letzten zwölf Monaten keine Erträge geliefert.**

(d) **Nullkuponwertpapier.**

(e) **Der Kupon stellt eine Rendite bis zur Endfälligkeit dar.**

(f) **Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.**

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

(h) **Mit dem Fonds verbunden.**

(i) **Bedingt wandelbares Wertpapier.**

(i) **Eingeschränkte Wertpapiere (31. Dezember 2022: 0,76 %):**

Emittentenbeschreibung	Kauf-datum	Kosten	Markt-wert	% des Nettovermögens
Constellation Oil Services Holding S.A. ‘B’	10.06.2022	$ 41	$ 41	0,00
Development Bank of Southern Africa 8,600 % fällig am 21.10.2024	07.10.2021	14.861	11.513	0,41
DrillCo Holding Lux S.A.	08.06.2023	158	151	0,01
Flourish Century 6,600 % fällig am 04.02.2022	25.08.2021	2.759	310	0,01
		$ 17.819	$ 12.015	0,43

(k) **Wertpapiere mit einem gesamten beizulegenden Zeitwert von 153.171 USD (31. Dezember 2022: 86.429 USD) und Barmittel in Höhe von 3.296 USD (31. Dezember 2022: 1.840 USD) wurden zum 30. Juni 2023 gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte als Sicherheit verpfändet.**

Barmittel in Höhe von 285 USD (31. Dezember 2022: null USD) wurden zum 30. Juni 2023 gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte als Sicherheit geliefert.

Barmittel in Höhe von 25.147 USD (31. Dezember 2022: 21.557 USD) wurden zum 30. Juni 2023 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Barmittel in Höhe von 17.830 USD (31. Dezember 2022: 28.320 USD) wurden zum 30. Juni 2023 gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. als Sicherheit für Finanzderivate verpfändet.

Beizulegender Zeitwert[1]

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 30. Juni 2023 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie[2]	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	$ 0	$ 2.405.489	$ 143.534	$ 2.549.023
Investmentfonds	269.736	0	0	269.736
Finanzderivate[3]	101	14.259	348	14.708
Einlagen bei Kreditinstituten	0	5.576	13.451	19.027
Summen	**$ 269.837**	**$ 2.425.324**	**$ 157.333**	**$ 2.852.494**

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

Kategorie[2]	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	$ 0	$ 1.695.287	$ 77.697	$ 1.772.984
Investmentfonds	131.643	0	0	131.643
Finanzderivate[3]	739	1.315	(11)	2.043
Einlagen bei Kreditinstituten	0	3.012	4.042	7.054
Summen	**$ 132.382**	**$ 1.699.614**	**$ 81.728**	**$ 1.913.724**

(1) Siehe Erläuterung 3 in den Erläuterungen zum Abschluss für weitere Informationen.

(2) Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung des Wertpapierbestands.

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

Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2023:

Kontrahent	Kredit-zins	Abrechnungs-datum	Fälligkeits-datum	Kredit-betrag	Verbindlichkeiten aus umgekehrten Pensions-geschäften	% des Nettovermögens
BRC	7,000 %	12.12.2022	TBD [1]	PLN (197.832)	$ (50.507)	(1,81)
	7,000	16.03.2023	TBD [1]	(91.297)	(22.921)	(0,82)
JML	4,700	29.06.2023	TBD [1]	$ (6.862)	(6.864)	(0,25)
MBC	8,750	15.06.2023	06.07.2023	ZAR (241.488)	(12.833)	(0,46)
	8,850	15.06.2023	TBD [1]	(621.035)	(33.007)	(1,19)
SCX	8,700	23.03.2023	TBD [1]	(441.680)	(23.881)	(0,86)
Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte					**$ (150.013)**	**(5,39)**

(1) Umgekehrtes Pensionsgeschäft mit offener Laufzeit.

Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC-Finanzderivate und -Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2023 und 31. Dezember 2022:

	Zum 30. Jun. 2023			Zum 31. Dez. 2022		
Kontrahent	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-Engagement[1]	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-Engagement[1]
BOA	$ 3.256	$ (3.010)	$ 246	$ 13.050	$ (12.520)	$ 530
BPS	(57)	690	633	(16.890)	15.580	(1.310)
BRC	4.184	(3.420)	764	(1.554)	1.440	(114)
BSH	(885)	0	(885)	(1.101)	0	(1.101)
BSS	0	890	890	0	920	920
CBK	(1.093)	1.340	247	6.571	(6.325)	246
CKL	(271)	0	(271)	(265)	0	(265)
CLY	k. A.	k. A.	k. A.	2.606	0	2.606
DUB	(23)	(220)	(243)	50	0	50
GLM	21.067	(18.700)	2.367	10.551	(10.070)	481
GST	746	(780)	(34)	(180)	190	10
HUS	8.011	(7.910)	101	6.780	(6.910)	(130)
IND	(486)	440	(46)	(834)	(1.510)	(2.344)
JPM	(836)	650	(186)	1.710	(1.280)	430
MBC	7.619	(7.270)	349	5.248	(4.930)	318
MYC	(118)	0	(118)	(365)	410	45
MYI	(7.841)	8.050	209	(4.865)	3.730	(1.135)
RBC	2.467	(2.320)	147	(4.253)	4.420	167
RYL	(449)	290	(159)	274	(260)	14
SCX	(4.981)	4.200	(781)	1.418	(1.120)	298
SOG	(122)	210	88	(587)	590	3
SSB	760	(830)	(70)	(924)	1.040	116
TOR	1.702	(1.280)	422	309	(270)	39
UAG	(1.608)	1.070	(538)	4.355	(4.700)	(345)

(1) Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären.

Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung des Wertpapierbestands zum 30. Juni 2023:

	30. Jun. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	72,29	63,67
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	19,22	27,35
Sonstige übertragbare Wertpapiere	0,01	1,33
Investmentfonds	9,68	6,86
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	0,01	0,04
Zentral abgerechnete Finanzderivate	(0,59)	(1,03)
Freiverkehrsfinanzderivate	1,11	1,10
Einlagenzertifikate	0,68	0,37
Umgekehrte Pensionsgeschäfte	(5,39)	(4,45)

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 30. Juni 2023 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	30. Jun. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
Argentinien	0,01	0,16
Aserbaidschan	0,10	0,23
Bahamas	k. A.	0,13
Brasilien	3,24	4,48
Cayman-Inseln	0,26	0,44
Chile	3,01	2,06
China	5,37	5,74
Kolumbien	3,67	3,65
Tschechische Republik	3,39	2,89
Dänemark	0,00	0,00
Dominikanische Republik	2,69	1,30
Ungarn	1,97	0,40
Indonesien	6,13	5,26
International	0,58	k. A.
Irland	0,58	0,83
Israel	0,80	1,75
Elfenbeinküste	0,24	0,38
Jersey, Kanalinseln	0,28	0,51
Kasachstan	k. A.	0,05
Luxemburg	0,02	0,01
Malaysia	10,11	9,11
Mexiko	10,23	8,11
Niederlande	0,07	0,20
Nigeria	0,12	0,22
Peru	3,64	2,32
Philippinen	0,10	0,04
Polen	5,16	4,79
Katar	0,66	0,92
Rumänien	2,06	3,99
Russland	0,18	0,26
Serbien	0,11	0,15
Südafrika	11,58	13,70
Südkorea	0,35	0,18
Supranational	0,93	0,37
Tansania	0,32	0,49
Thailand	6,34	4,23
Türkei	0,38	0,53
Vereinigte Arabische Emirate	1,17	1,60
Großbritannien	0,29	0,58
USA	1,97	2,50
Uruguay	0,40	k. A.
Jungferninseln (Britisch)	k. A.	0,31
Sambia	0,18	k. A.
Kurzfristige Instrumente	2,83	7,48
Investmentfonds	9,68	6,86
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	0,01	0,04
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen - Schutzverkauf	0,00	0,00
Zinsswaps	(0,59)	(1,03)
Freiverkehrsfinanzderivate		
Optionskauf		
Devisenoptionen	0,28	0,13
Straddle-Optionen	0,00	k. A.
Verkaufsoptionen		
Devisenoptionen	(0,08)	(0,01)
Zinsswapoptionen	(0,01)	(0,01)
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen - Schutzkauf	0,04	k. A.
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen - Schutzverkauf	0,00	(0,14)
Cross-Currency Swaps	0,30	0,42
Zinsswaps	0,06	0,19
Volatilitätsswaps	k. A.	0,00
Devisenterminkontrakte	0,52	0,52
Einlagenzertifikate	0,68	0,37
Sonstige Aktiva und Passiva	(2,41)	0,31
Nettovermögen	100,00	100,00

Aufstellung des Wertpapierbestands des Emerging Local Bond ESG Fund

BESCHREIBUNG		PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE				
CHILE				
STAATSEMISSIONEN				
Bonos de la Tesoreria de la Republica en Pesos				
2,800 % fällig am 01.10.2033	CLP	45.000	$ 45	0,59
5,000 % fällig am 01.10.2028		60.000	74	0,96
6,000 % fällig am 01.04.2033		100.000	132	1,72
			251	3,27
KOLUMBIEN				
STAATSEMISSIONEN				
Colombian TES				
7,000 % fällig am 26.03.2031	COP	1.443.100	292	3,80
13,250 % fällig am 09.02.2033		18.100	5	0,06
			297	3,86
TSCHECHISCHE REPUBLIK				
STAATSEMISSIONEN				
Czech Republic Government International Bond				
0,050 % fällig am 29.11.2029	CZK	3.400	119	1,55
0,250 % fällig am 10.02.2027		1.300	51	0,66
1,200 % fällig am 13.03.2031		900	33	0,43
1,500 % fällig am 24.04.2040		400	12	0,16
1,750 % fällig am 23.06.2032		1.000	37	0,48
1,950 % fällig am 30.07.2037		200	7	0,09
2,000 % fällig am 13.10.2033		1.800	67	0,87
2,400 % fällig am 17.09.2025		4.800	208	2,70
4,200 % fällig am 04.12.2036		600	27	0,35
5,000 % fällig am 30.09.2030		2.200	105	1,36
			666	8,65
DOMINIKANISCHE REPUBLIK				
STAATSEMISSIONEN				
Zentralbanknoten der Dominikanischen Republik				
12,000 % fällig am 03.10.2025	DOP	900	17	0,22
13,000 % fällig am 05.12.2025		3.600	70	0,91
Dominican Republic Government International Bond				
13,625 % fällig am 10.02.2034		2.000	46	0,60
			133	1,73
DEUTSCHLAND				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Kreditanstalt fuer Wiederaufbau				
0,625 % fällig am 25.07.2025	PLN	500	110	1,43
5,800 % fällig am 19.01.2028	ZAR	2.500	115	1,49
			225	2,92
UNGARN				
STAATSEMISSIONEN				
Hungary Government International Bond				
4,000 % fällig am 28.04.2051	HUF	15.900	30	0,39
4,500 % fällig am 27.05.2032 (d)		46.600	114	1,48
4,750 % fällig am 24.11.2032		2.000	5	0,07
6,750 % fällig am 22.10.2028		22.800	64	0,83
			213	2,77
INDONESIEN				
STAATSEMISSIONEN				
Indonesia Government International Bond				
6,375 % fällig am 15.04.2032	IDR	1.467.000	99	1,29
6,375 % fällig am 15.04.2042		565.000	37	0,48
7,000 % fällig am 15.02.2033		44.000	3	0,04
7,125 % fällig am 15.06.2042		17.000	1	0,01
7,500 % fällig am 15.06.2035		171.000	12	0,16
7,500 % fällig am 15.05.2038		193.000	14	0,18
8,250 % fällig am 15.05.2036		1.335.000	103	1,34
8,375 % fällig am 15.03.2034	IDR	554.000	$ 43	0,56
8,750 % fällig am 15.05.2031		1.178.000	90	1,17
			402	5,23
MALAYSIA				
STAATSEMISSIONEN				
Malaysia Government International Bond				
2,632 % fällig am 15.04.2031	MYR	410	81	1,05
3,582 % fällig am 15.07.2032		150	32	0,42
3,757 % fällig am 22.05.2040		12	3	0,04
3,800 % fällig am 17.08.2023		500	107	1,39
4,065 % fällig am 15.06.2050		122	26	0,34
4,762 % fällig am 07.04.2037		170	39	0,51
Malaysia Government Investment Issue				
3,465 % fällig am 15.10.2030		230	48	0,62
3,990 % fällig am 15.10.2025		88	19	0,25
4,130 % fällig am 09.07.2029		910	199	2,59
4,193 % fällig am 07.10.2032		278	61	0,79
4,369 % fällig am 31.10.2028		412	91	1,18
4,417 % fällig am 30.09.2041		164	36	0,47
			742	9,65
MEXIKO				
STAATSEMISSIONEN				
Mexico Government International Bond				
7,000 % fällig am 03.09.2026	MXN	100	5	0,06
7,500 % fällig am 03.06.2027		3.400	188	2,44
7,500 % fällig am 26.05.2033		2.400	129	1,68
7,750 % fällig am 29.05.2031		1.300	72	0,94
7,750 % fällig am 13.11.2042		800	42	0,55
8,000 % fällig am 07.11.2047		929	50	0,65
8,500 % fällig am 18.11.2038		2.400	137	1,78
			623	8,10
PERU				
STAATSEMISSIONEN				
Peru Government International Bond				
5,400 % fällig am 12.08.2034	PEN	200	49	0,64
6,900 % fällig am 12.08.2037		100	27	0,35
7,300 % fällig am 12.08.2033		950	271	3,52
			347	4,51
POLEN				
STAATSEMISSIONEN				
Poland Government International Bond				
1,250 % fällig am 25.10.2030	PLN	59	11	0,14
1,750 % fällig am 25.04.2032		250	45	0,59
2,500 % fällig am 25.07.2026		500	112	1,46
2,750 % fällig am 25.10.2029		100	21	0,27
6,000 % fällig am 25.10.2033		500	125	1,63
7,500 % fällig am 25.07.2028		300	80	1,04
			394	5,13
RUMÄNIEN				
STAATSEMISSIONEN				
Romania Government International Bond				
4,150 % fällig am 26.01.2028	RON	300	60	0,78
4,150 % fällig am 24.10.2030		200	38	0,49
4,250 % fällig am 28.04.2036		465	80	1,04
4,750 % fällig am 11.10.2034		40	7	0,09
6,625 % fällig am 27.09.2029	€	15	17	0,22
			202	2,62
SÜDAFRIKA				
STAATSEMISSIONEN				
South Africa Government International Bond				
2,000 % fällig am 31.01.2025 (c)	ZAR	523	27	0,35
8,000 % fällig am 31.01.2030	ZAR	1.000	$ 47	0,61
8,250 % fällig am 31.03.2032		1.700	76	0,99
8,500 % fällig am 31.01.2037		500	20	0,26
8,750 % fällig am 31.01.2044		1.400	54	0,70
8,750 % fällig am 28.02.2048		3.900	150	1,95
9,000 % fällig am 31.01.2040		1.100	45	0,59
10,500 % fällig am 21.12.2026		1.700	93	1,21
			512	6,66
SUPRANATIONAL				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Asian Development Bank				
4,700 % fällig am 12.03.2024	MXN	2.200	121	1,57
6,000 % fällig am 05.02.2026	BRL	750	145	1,89
12,750 % fällig am 03.03.2025	COP	339.000	83	1,08
Asiatische Infrastrukturinvestmentbank				
4,250 % fällig am 27.01.2027	PHP	600	10	0,13
Europäische Bank für Wiederaufbau und Entwicklung				
3,010 % fällig am 13.03.2028	PLN	600	128	1,66
5,080 % fällig am 15.12.2025	MXN	1.900	98	1,27
Europäische Investitionsbank				
2,875 % fällig am 15.11.2029	PLN	500	104	1,35
Internationale Bank für Wiederaufbau und Entwicklung				
4,500 % fällig am 22.01.2026	ZAR	2.200	105	1,37
4,750 % fällig am 21.01.2027	IDR	2.880.000	186	2,42
7,070 % fällig am 26.06.2029	MXN	1.400	75	0,98
8,500 % fällig am 06.04.2026		2.000	112	1,46
9,750 % fällig am 21.01.2027	BRL	750	158	2,05
International Finance Corp.				
8,000 % fällig am 09.10.2023	IDR	2.200.000	147	1,91
			1.472	19,14
THAILAND				
STAATSEMISSIONEN				
Thailand Government International Bond				
1,585 % fällig am 17.12.2035	THB	806	20	0,26
2,000 % fällig am 17.12.2031		830	23	0,30
2,000 % fällig am 17.06.2042		180	4	0,05
2,350 % fällig am 17.06.2026		7.419	210	2,73
2,650 % fällig am 17.06.2028		4.349	125	1,63
3,350 % fällig am 17.06.2033		940	28	0,36
3,400 % fällig am 17.06.2036		2.001	60	0,78
3,450 % fällig am 17.06.2043		1.117	33	0,43
3,775 % fällig am 25.06.2032		277	9	0,12
			512	6,66
URUGUAY				
STAATSEMISSIONEN				
Uruguay Government International Bond				
3,700 % fällig am 26.06.2037 (c)	UYU	346	10	0,13
8,500 % fällig am 15.03.2028		3.200	82	1,06
			92	1,19
KURZFRISTIGE INSTRUMENTE				
U.S. TREASURY BILLS				
5,156 % fällig am 03.08.2023 (a)(b)	$	200	199	2,59
5,166 % fällig am 08.08.2023 (a)(b)		100	100	1,30
5,239 % fällig am 07.09.2023 (a)(b)		200	198	2,57
Summe kurzfristige Instrumente			497	6,46
Summe Übertragbare Wertpapiere			**$ 7.580**	**98,55**

ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)

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

ZINSSWAPS

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits-datum		Nenn-betrag		Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Zahlung	1-Year BRL-CDI	10,565 %	04.01.2027	BRL	900	$	2	0,03
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,140	04.01.2027		900		11	0,12

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Erhalt	1-Year BRL-CDI	11,200 %	04.01.2027	BRL 400	$ (2)	(0,03)
Erhalt	1-Year BRL-CDI	11,244	02.01.2026	500	(2)	(0,03)
Erhalt	1-Year BRL-CDI	11,380	04.01.2027	100	(1)	(0,01)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,400	04.01.2027	250	1	0,02
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,410	04.01.2027	250	1	0,02
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,420	02.01.2026	600	3	0,03
Erhalt	1-Year BRL-CDI	11,445	02.01.2025	300	0	0,00
Erhalt	1-Year BRL-CDI	11,515	02.01.2025	400	0	0,00
Erhalt	1-Year BRL-CDI	11,540	02.01.2024	2.700	0	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,725	02.01.2025	1.500	0	0,01
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,734	02.01.2025	200	0	0,00
Erhalt	1-Year BRL-CDI	11,740	02.01.2025	100	0	0,00
Erhalt	1-Year BRL-CDI	11,750	02.01.2025	100	0	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,800	02.01.2025	300	0	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,810	02.01.2025	400	1	0,01
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,835	02.01.2025	300	0	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,845	02.01.2025	600	0	0,01
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,870	02.01.2025	500	0	0,01
Erhalt	1-Year BRL-CDI	11,905	04.01.2027	200	(2)	(0,02)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	12,005	02.01.2025	500	0	0,00
Erhalt	1-Year BRL-CDI	12,090	02.01.2025	400	(1)	(0,01)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	12,090	04.01.2027	300	3	0,03
Zahlung	1-Year BRL-CDI	12,091	04.01.2027	200	2	0,02
Zahlung	1-Year BRL-CDI	12,210	02.01.2025	300	0	0,01
Erhalt	1-Year BRL-CDI	12,350	01.07.2024	900	0	(0,01)
Erhalt	1-Year BRL-CDI	12,490	01.07.2024	900	(1)	(0,01)
Erhalt	1-Year BRL-CDI	12,533	02.01.2029	300	(5)	(0,05)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	12,595	01.07.2024	900	1	0,01
Zahlung	1-Year BRL-CDI	12,684	02.01.2029	300	4	0,05
Erhalt	1-Year BRL-CDI	12,740	02.01.2025	300	(1)	(0,02)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	12,746	02.01.2029	300	4	0,06
Erhalt	1-Year BRL-CDI	12,765	02.01.2025	100	0	(0,01)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	13,080	02.01.2024	3.400	5	0,05
Zahlung	1-Year BRL-CDI	13,080	01.07.2024	1.800	4	0,05
Erhalt	1-Year BRL-CDI	13,190	02.01.2025	200	(1)	(0,01)
Erhalt	1-Year BRL-CDI	13,215	02.01.2025	100	(1)	(0,01)
Erhalt	1-Year BRL-CDI	13,218	02.01.2029	700	(13)	(0,16)
Erhalt	1-Year BRL-CDI	13,400	02.01.2025	400	(2)	(0,03)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	13,995	02.01.2024	900	1	0,01
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	8,190	13.06.2029	COP 180.300	1	0,02
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	8,305	28.04.2028	124.600	1	0,01
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	8,390	13.06.2028	65.600	0	0,01
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	8,495	27.04.2030	40.000	0	0,01
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	8,950	24.03.2030	130.000	(2)	(0,03)
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	9,040	05.05.2030	1.200	0	0,00
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	9,300	26.03.2031	136.900	(5)	(0,05)
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	9,370	17.03.2030	47.800	(1)	(0,01)
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	9,393	21.03.2030	111.700	(3)	(0,04)
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	9,410	26.03.2031	123.400	(3)	(0,04)
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	9,423	17.03.2030	141.500	(4)	(0,04)
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	9,930	07.03.2033	34.420	(1)	(0,02)
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	10,400	21.11.2029	18.300	(1)	(0,01)
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	10,500	21.03.2025	614.100	2	0,02
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	10,550	17.03.2025	43.090	0	0,00
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	11,353	15.11.2027	151.660	6	0,06
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	12,000	26.11.2025	124.890	(2)	(0,03)
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	12,070	26.11.2025	128.000	(2)	(0,03)
Zahlung	3-Month KRW-KORIBOR	3,250	15.03.2033	KRW 218.574	(2)	(0,03)
Zahlung	3-Month THB-THORON Compounded-OIS	2,250	15.03.2028	THB 4.530	0	0,00
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	8,120	13.03.2028	ZAR 300	0	0,00
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	8,830	23.02.2030	600	0	0,00
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	10,150	18.05.2033	300	1	0,01
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	5,030	20.03.2033	CLP 5.340	0	0,00
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	5,770	21.11.2027	28.300	(1)	(0,01)
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	6,070	28.02.2028	55.800	(2)	(0,02)
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	7,160	01.10.2028	3.800	1	0,01
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	7,195	01.10.2028	2.100	0	0,00
Zahlung	6-Month CZK-PRIBOR	4,611	06.06.2028	CZK 9.600	(2)	(0,02)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	3,000	20.09.2028	€ 100	(1)	(0,02)
Zahlung	6-Month HUF-BBR	10,570	22.08.2027	HUF 4.800	2	0,02
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR	5,220	20.03.2033	PLN 100	0	0,00
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR	5,295	25.01.2028	1.850	(1)	(0,02)
Zahlung	6-Month PLN-WIBOR	5,520	20.03.2026	300	0	0,00
Zahlung	6-Month PLN-WIBOR	5,870	22.04.2027	200	2	0,03
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR	6,830	19.08.2024	100	(1)	(0,01)
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR	6,890	22.08.2024	300	(3)	(0,04)
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	8,207	19.06.2028	MXN 600	0	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	8,300	16.06.2028	1.200	0	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	8,438	20.03.2028	700	0	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	8,448	27.04.2028	400	0	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	8,450	27.04.2028	900	0	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	8,560	18.05.2028	300	0	0,00

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	8,585 %	18.05.2028	MXN 300	$ 0	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	8,600	18.05.2028	100	0	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	8,610	18.05.2028	100	0	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	8,645	18.05.2028	100	0	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	8,656	18.05.2028	200	0	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	8,720	19.05.2028	100	0	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	8,722	19.05.2028	100	0	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	8,755	19.05.2028	100	0	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	8,762	13.04.2028	2.300	(2)	(0,03)
					$ (12)	(0,16)
Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate					**$ (12)**	**(0,16)**

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

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

OPTIONSKAUF

DEVISENOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag[1]	Kosten	Markt-wert	% des Nettovermögens
BOA	Put - OTC EUR versus CZK	CZK 23,830	01.11.2023	8	$ 1	$ 3	0,05
GLM	Put - OTC EUR versus HUF	HUF 385,000	01.11.2023	3	0	2	0,02
	Put - OTC EUR versus PLN	PLN 4,560	01.11.2023	6	1	5	0,06
MYI	Put - OTC USD versus BRL	BRL 4,820	22.08.2023	70	1	1	0,01
	Put - OTC USD versus MXN	MXN 18,500	25.07.2023	71	2	6	0,07
RBC	Put - OTC USD versus CAD	CAD 1,305	13.07.2023	71	0	0	0,00
UAG	Call - OTC EUR versus USD	$ 1,140	13.07.2023	64	0	0	0,00
	Call - OTC USD versus ZAR	ZAR 20,500	09.10.2023	112	2	1	0,02
					$ 7	$ 18	0,23

STRADDLE-OPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungs-kurs[2]	Verfalls-datum	Nenn-betrag[1]	Kosten[2]	Markt-wert	% des Nettovermögens
BOA	Call & Put - OTC 6-Month vs. 6-Month Forward Volatility Agreement	12,600 %	27.12.2023	100	$ 0	$ 0	0,00
CBK	Call & Put - OTC 6-Month vs. 6-Month Forward Volatility Agreement	15,100	20.12.2023	100	0	0	0,00
MYI	Call & Put - OTC 6-Month vs. 6-Month Forward Volatility Agreement	12,600	27.12.2023	50	0	0	0,00
					$ 0	$ 0	0,00

VERKAUFSOPTIONEN

DEVISENOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag[1]	Aufgeld	Markt-wert	% des Nettovermögens
JPM	Call - OTC USD versus INR	IDR 14.950,000	06.06.2024	21	$ (1)	$ (1)	(0,01)
	Put - OTC USD versus INR	14.950,000	06.06.2024	21	(1)	(1)	(0,01)
MYI	Call - OTC USD versus CLP	CLP 850,000	18.07.2023	41	(1)	0	0,00
	Put - OTC USD versus MXN	MXN 17,750	25.07.2023	142	(1)	(4)	(0,05)
	Call - OTC USD versus MXN	21,000	07.03.2024	67	0	0	(0,01)
					$ (4)	$ (6)	(0,08)

(1) Der Nennbetrag stellt die Anzahl der Kontrakte dar.

(2) Ausübungskurs und endgültige Kosten werden zu einem zukünftigen Zeitpunkt auf der Basis impliziter Volatilitätsparameter festgelegt.

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMMISSIONEN - SCHUTZKAUF[1]

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu bezahlender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag[2]	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Markt-wert	% des Nettovermögens
GST	Turkey Government International Bond	(1,000) %	20.06.2024	$ 100	$ 3	$ (2)	$ 1	0,01

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

(2) Der maximal mögliche Betrag, den der Fonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

ZINSSWAPS

Kontrahent	Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Markt-wert	% des Nettovermögens
BOA	Erhalt	3-Month MYR-KLIBOR	3,500 %	15.03.2028	MYR 10	$ 0	$ 0	$ 0	0,00
	Erhalt	3-Month MYR-KLIBOR	3,750	15.03.2028	770	(2)	1	(1)	(0,01)
GLM	Erhalt	3-Month MYR-KLIBOR	3,545	05.05.2028	308	0	1	1	0,01
						$ (2)	$ 2	$ 0	0,00

DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung		Zu erhaltende Währung		Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2023	CZK	5.325	$	245	$ 1	$ 0	$ 1	0,01
	07.2023	PHP	1.932		35	0	0	0	0,00
	07.2023	PLN	15		4	0	0	0	0,00
	07.2023	$	136	ILS	490	0	(5)	(5)	(0,06)
	08.2023	MXN	470	$	25	0	(2)	(2)	(0,02)
	08.2023	NZD	20		13	0	0	0	0,01
	08.2023	$	2	EGP	82	0	0	0	0,00
	08.2023		24	€	22	0	0	0	0,00
	08.2023		141	ILS	489	0	(10)	(10)	(0,12)
	08.2023	ZAR	454	$	24	0	0	0	0,00
	09.2023	$	9	CLP	7.227	0	0	0	0,00
	09.2023		35	MYR	160	0	0	0	(0,01)
	09.2023		26	THB	906	0	(1)	(1)	(0,01)
	09.2023		47	TWD	1.438	0	(1)	(1)	(0,01)
	10.2023	ZAR	297	$	16	0	0	0	0,01
	11.2023	€	49	CZK	1.206	1	0	1	0,01
BPS	07.2023	BRL	280	$	57	0	(1)	(1)	(0,01)
	07.2023	MYR	52		11	0	0	0	0,00
	07.2023	$	32	BRL	158	1	0	1	0,01
	07.2023		9	CZK	189	0	0	0	0,00
	07.2023		92	MYR	423	0	(1)	(1)	(0,02)
	07.2023		49	PHP	2.755	1	0	1	0,01
	07.2023		11	RON	51	0	0	0	0,00
	07.2023		29	SGD	39	0	0	0	(0,01)
	08.2023	CLP	67.282	$	82	0	(2)	(2)	(0,03)
	08.2023	MXN	4.241		244	0	(2)	(2)	(0,02)
	08.2023	MYR	507		109	0	0	0	0,00
	08.2023	$	22	COP	98.915	1	0	1	0,02
	08.2023		11	€	10	0	0	0	0,00
	08.2023		24	TWD	720	0	0	0	(0,01)
	08.2023	ZAR	238	$	13	0	0	0	0,00
	09.2023	PHP	4.716		84	0	(1)	(1)	(0,02)
	09.2023	$	7	CLP	5.724	0	0	0	0,00
	09.2023		11	IDR	163.593	0	0	0	0,00
	09.2023		8	INR	658	0	0	0	0,00
	09.2023		41	THB	1.421	0	(1)	(1)	(0,01)
	12.2023	MXN	143	$	8	0	0	0	0,00
BRC	07.2023	PHP	75		1	0	0	0	0,00
	07.2023	PLN	16		4	0	0	0	0,00
	07.2023	SGD	53		40	1	0	1	0,01
	07.2023	$	45	MYR	207	0	0	0	(0,01)
	07.2023		7	PHP	391	0	0	0	0,00
	07.2023		18	PLN	73	0	0	0	0,00
	07.2023		14	RON	64	0	0	0	0,00
	08.2023	COP	750.524	$	176	0	(1)	(1)	(0,02)
	08.2023	$	5	£	4	0	0	0	0,00
	08.2023		12	HUF	4.164	0	0	0	0,00
	08.2023		65	¥	8.553	0	(6)	(6)	(0,07)
	09.2023		1	ILS	4	0	0	0	0,00
	09.2023		11	MXN	183	0	0	0	0,00
	09.2023		40	PEN	147	0	0	0	0,00
	10.2023	MXN	1.202	$	64	0	(6)	(6)	(0,06)
	10.2023	TRY	189		7	0	0	0	0,00
CBK	07.2023	BRL	58		12	0	0	0	0,00
	07.2023	CLP	47.605		59	0	0	0	(0,01)
	07.2023	COP	30.503		7	0	(1)	(1)	(0,01)
	07.2023	ILS	688		209	24	0	24	0,30
	07.2023	MXN	5.000		260	0	(32)	(32)	(0,41)
	07.2023	PHP	1.140		21	0	0	0	0,00
	07.2023	PLN	194		46	0	(2)	(2)	(0,02)
	07.2023	$	32	BRL	153	0	0	0	0,00
	07.2023		31	COP	138.941	4	0	4	0,03
	07.2023		8	CZK	174	0	0	0	0,00
	07.2023		57	MXN	1.005	2	0	2	0,03
	07.2023		29	PEN	105	0	0	0	0,00
	07.2023		29	PLN	119	0	0	0	0,01
	07.2023		80	UYU	2.993	1	0	1	0,01
	07.2023	UYU	5.812	$	150	0	(6)	(6)	(0,06)
	08.2023	BRL	319		62	0	(5)	(5)	(0,05)

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung		Zu erhaltende Währung		Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
	08.2023	CAD	6	$	5	$ 0	$ 0	$ 0	0,00
	08.2023	COP	63.876		15	0	0	0	0,00
	08.2023	EGP	82		2	0	0	0	0,00
	08.2023	ILS	491		152	21	0	21	0,26
	08.2023	¥	9.700		71	5	0	5	0,05
	08.2023	PEN	6		1	0	0	0	0,00
	08.2023	$	12	BRL	58	0	0	0	0,00
	08.2023		81	CLP	67.282	2	0	2	0,03
	08.2023		62	€	57	0	0	0	0,01
	08.2023		7	¥	1.000	0	0	0	(0,01)
	08.2023		3	NOK	31	0	0	0	0,00
	08.2023		25	TWD	750	0	0	0	(0,01)
	08.2023		23	ZAR	418	0	(1)	(1)	(0,01)
	09.2023	COP	14.111	$	3	0	0	0	0,00
	09.2023	PEN	363		99	0	0	0	0,00
	09.2023	$	13	IDR	201.090	0	0	0	0,00
	09.2023		36	INR	2.955	0	0	0	0,00
	09.2023		10	THB	343	0	0	0	0,00
	11.2023	ILS	98	$	29	4	0	4	0,04
	11.2023	$	35	EGP	1.145	0	(2)	(2)	(0,03)
	02.2024	EGP	295	$	8	0	0	0	0,00
	02.2024	$	42	EGP	1.468	0	(3)	(3)	(0,03)
GLM	07.2023	BRL	2.459	$	509	0	0	0	(0,01)
	07.2023	COP	20.469		5	0	0	0	0,00
	07.2023	DOP	4.044		70	0	(2)	(2)	(0,03)
	07.2023	ILS	196		58	6	0	6	0,07
	07.2023	PEN	67		18	0	0	0	0,00
	07.2023	PLN	36		8	0	0	0	(0,01)
	07.2023	$	430	BRL	2.305	49	0	49	0,63
	07.2023		2	COP	8.480	0	0	0	0,00
	07.2023		31	CZK	667	0	0	0	(0,01)
	07.2023		7	DOP	394	0	0	0	0,00
	07.2023		203	MXN	3.554	5	0	5	0,06
	07.2023		13	MYR	60	0	0	0	0,00
	07.2023		16	RON	70	0	0	0	0,00
	07.2023		79	SGD	104	0	(1)	(1)	(0,02)
	08.2023	BRL	28	$	6	0	0	0	0,00
	08.2023	DOP	1.127		20	0	0	0	0,00
	08.2023	$	115	HUF	39.111	0	(2)	(2)	(0,02)
	08.2023		4	NOK	39	0	0	0	0,00
	08.2023		9	PEN	33	0	0	0	0,00
	08.2023	ZAR	191	$	10	0	0	0	0,00
	09.2023	TRY	608		24	1	0	1	0,02
	09.2023	TWD	1.060		35	1	0	1	0,01
	09.2023	$	509	BRL	2.486	0	0	0	0,01
	09.2023		5	COP	21.367	0	0	0	0,00
	09.2023		9	PEN	34	0	0	0	0,00
	09.2023		75	THB	2.581	0	(1)	(1)	(0,02)
	10.2023	DOP	1.459	$	26	0	0	0	0,00
	11.2023	CZK	1.206	€	49	0	(1)	(1)	(0,01)
	11.2023	DOP	170	$	3	0	0	0	0,00
	11.2023	EGP	1.534		51	8	0	8	0,09
	11.2023	€	46	PLN	206	0	0	0	0,00
	11.2023	$	2	EGP	75	0	0	0	0,00
	12.2023	DOP	223	$	4	0	0	0	0,00
	01.2024	EGP	761		20	0	0	0	0,00
	01.2024	$	10	EGP	329	0	(1)	(1)	(0,01)
	01.2024	ZAR	599	$	34	3	0	3	0,04
JPM	07.2023	RON	203		44	0	(1)	(1)	(0,01)
	07.2023	TRY	455		17	0	0	0	0,00
	07.2023	$	15	BRL	75	1	0	1	0,01
	07.2023		33	MXN	567	0	0	0	0,00
	08.2023	CAD	11	$	8	0	0	0	0,00
	08.2023	CHF	8		9	0	0	0	0,00
	08.2023	COP	36.076		9	0	0	0	0,00
	08.2023	€	25		28	0	0	0	0,00
	08.2023	£	6		8	0	0	0	0,00
	08.2023	$	9	BRL	44	0	0	0	0,00
	08.2023		10	£	8	0	0	0	0,00
	08.2023		170	HUF	59.239	1	0	1	0,02
	08.2023		11	¥	1.406	0	(1)	(1)	(0,01)
	08.2023		1	NOK	14	0	0	0	0,00
	08.2023		4	UYU	163	0	0	0	0,00
	08.2023	ZAR	520	$	27	0	(1)	(1)	(0,01)
	09.2023	IDR	392.787		26	0	0	0	0,00
	09.2023	PEN	266		72	0	(1)	(1)	(0,01)
	09.2023	$	1	ILS	3	0	0	0	0,00
	09.2023		9	INR	740	0	0	0	0,00
	09.2023		3	PEN	12	0	0	0	0,00
	09.2023		20	THB	691	0	0	0	(0,01)
	01.2024	EGP	147	$	4	0	0	0	0,00
	04.2024	TRY	533		17	0	0	0	0,00
	06.2024	$	3	IDR	45.000	0	0	0	0,00

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung		Zu erhaltende Währung		Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
MBC	07.2023	PLN	633	$	147	$ 0	$ (10)	$ (10)	(0,11)
	07.2023	$	10	MXN	174	0	0	0	0,00
	07.2023		155	RON	703	0	0	0	0,00
	08.2023		9	ZAR	172	0	0	0	0,00
	09.2023		10	COP	42.586	0	0	0	0,00
	09.2023		1	THB	25	0	0	0	0,00
	01.2024		4	EGP	125	0	0	0	0,00
MYI	07.2023	CZK	409	$	19	0	0	0	0,00
	07.2023	MXN	228		13	0	(1)	(1)	(0,01)
	07.2023	PLN	35		8	0	0	0	0,00
	07.2023	$	68	COP	286.653	0	0	0	0,00
	07.2023		112	ILS	393	0	(7)	(7)	(0,08)
	07.2023		29	MYR	134	0	0	0	0,00
	07.2023		16	PLN	67	0	0	0	0,01
	08.2023	€	37	$	40	0	0	0	0,00
	08.2023	TWD	3		0	0	0	0	0,00
	08.2023	$	24	€	22	0	0	0	0,00
	08.2023		106	MXN	1.834	0	0	0	0,00
	08.2023		26	TWD	775	0	(1)	(1)	(0,01)
	08.2023	ZAR	75	$	4	0	0	0	0,00
	09.2023	IDR	100.437		7	0	0	0	0,00
	09.2023	$	30	IDR	449.763	0	0	0	0,00
	09.2023		102	THB	3.509	0	(3)	(3)	(0,03)
	01.2024	EGP	21	$	1	0	0	0	0,00
	01.2024	$	11	EGP	356	0	(1)	(1)	(0,01)
	02.2024	EGP	157	$	4	0	0	0	0,00
RYL	11.2023	$	28	ILS	98	0	(1)	(1)	(0,01)
SCX	07.2023	TRY	171	$	7	1	0	1	0,01
	07.2023	$	92	MYR	425	0	(1)	(1)	(0,02)
	08.2023	NZD	7	$	4	0	0	0	0,00
	09.2023	$	13	CLP	10.486	0	0	0	0,00
	09.2023		68	INR	5.614	1	0	1	0,01
	09.2023		10	PEN	38	0	0	0	0,00
	09.2023		39	TWD	1.202	0	(1)	(1)	(0,01)
	11.2023	EGP	110	$	3	0	0	0	0,00
	11.2023	$	10	EGP	387	1	0	1	0,02
	01.2024		0		7	0	0	0	0,00
	02.2024	EGP	188	$	5	0	0	0	0,00
SSB	07.2023	$	59	CLP	47.673	0	0	0	0,00
	08.2023	CLP	47.810	$	59	0	0	0	0,00
	09.2023	$	20	BRL	102	1	0	1	0,01
UAG	07.2023	COP	8.537	$	2	0	0	0	0,00
	07.2023	$	22	BRL	107	0	0	0	0,00
	07.2023		163	CZK	3.578	1	0	1	0,02
	07.2023		8	PLN	32	0	0	0	0,00
	07.2023		9	RON	40	0	0	0	0,00
	08.2023		9	CAD	12	0	0	0	0,00
	08.2023		2	COP	8.603	0	0	0	0,00
	08.2023		9	ZAR	160	0	0	0	0,00
	08.2023	ZAR	711	$	38	0	0	0	0,00
	09.2023	SGD	94		70	1	0	1	0,01
	09.2023	$	1	ILS	3	0	0	0	0,00
	09.2023		6	THB	216	0	0	0	0,00
	10.2023		16	ZAR	294	0	(1)	(1)	(0,01)
	04.2024		18	TRY	544	0	(1)	(1)	(0,01)
						$ 150	$ (132)	$ 18	0,24
Summe Freiverkehrsfinanzderivate								**$ 31**	**0,40**

BESCHREIBUNG		PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
EINLAGENZERTIFIKATE				
Banco Davivienda S.A.				
13,501 % fällig am 13.12.2024	COP	33.000	$ 8	0,10
15,389 % fällig am 21.02.2024		9.500	2	0,03
BanColombia S.A.				
5,917 % fällig am 27.01.2024		46.200	11	0,14
13,320 % fällig am 08.06.2025		17.000	4	0,05
13,637 % fällig am 14.12.2024		47.000	11	0,14
16,137 % fällig am 01.09.2024		18.000	4	0,05
BBVA Colombia S.A.				
5,870 % fällig am 15.07.2024		39.000	9	0,12
14,540 % fällig am 13.01.2024		18.800	5	0,07
Summe Einlagenzertifikate			**$ 54**	**0,70**
Summe Anlagen			**$ 7.653**	**99,49**
Sonstige Aktiva und Passiva			**$ 39**	**0,51**
Nettovermögen			**$ 7.692**	**100,00**

ERLÄUTERUNGEN ZUR AUFSTELLUNG DES WERTPAPIERBESTANDS (Angaben in Tausend*):

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

(a) Nullkuponwertpapier.

(b) Der Kupon stellt eine Rendite bis zur Endfälligkeit dar.

(c) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

(d) Wertpapier mit einem gesamten beizulegenden Zeitwert von 39.143 USD (31. Dezember 2022: null USD) wurden zum 30. Juni 2023 gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte als Sicherheit verpfändet.

Barmittel in Höhe von 60 USD (31. Dezember 2022: 39 USD) wurden zum 30. Juni 2023 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Beizulegender Zeitwert[1]

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 30. Juni 2023 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie[2]	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	$ 0	$ 7.580	$ 0	$ 7.580
Finanzderivate[3]	0	19	0	19
Einlagen bei Kreditinstituten	0	18	36	54
Summen	**$ 0**	**$ 7.617**	**$ 36**	**$ 7.653**

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

Kategorie[2]	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	$ 0	$ 6.270	$ 0	$ 6.270
Finanzderivate[3]	0	54	0	54
Einlagen bei Kreditinstituten	0	0	4	4
Summen	**$ 0**	**$ 6.324**	**$ 4**	**$ 6.328**

(1) Siehe Erläuterung 3 in den Erläuterungen zum Abschluss für weitere Informationen.

(2) Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung des Wertpapierbestands.

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

Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2023:

Kontrahent	Kredit-zins	Abrechnungs-datum	Fälligkeits-datum	Kredit-betrag	Verbindlichkeiten aus umgekehrten Pensions-geschäften	% des Nettovermögens
BPS	14,700 %	22.05.2023	TBD[1]	HUF (36.928)	$ (110)	(1,43)
Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte					**$ (110)**	**(1,43)**

(1) Umgekehrtes Pensionsgeschäft mit offener Laufzeit.

Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC-Finanzderivate und -Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2023 und 31. Dezember 2022:

	Zum 30. Jun. 2023			Zum 31. Dez. 2022		
Kontrahent	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-Engagement[1]	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-Engagement[1]
BOA	$ (15)	$ 0	$ (15)	$ 3	$ 0	$ 3
BPS	(5)	0	(5)	k. A.	k. A.	k. A.
BRC	(12)	0	(12)	33	0	33
CBK	11	0	11	26	0	26
GLM	73	(60)	13	30	0	30
GST	1	0	1	k. A.	k. A.	k. A.
JPM	(4)	0	(4)	k. A.	k. A.	k. A.
MBC	(10)	0	(10)	k. A.	k. A.	k. A.
MYI	(10)	0	(10)	(2)	0	(2)
RYL	(1)	0	(1)	k. A.	k. A.	k. A.
SCX	1	0	1	(35)	0	(35)
SSB	1	0	1	k. A.	k. A.	k. A.
UAG	1	0	1	k. A.	k. A.	k. A.

(1) Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären.

Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung des Wertpapierbestands zum 30. Juni 2023:

	30. Jun. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	85,31	69,10
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	13,24	24,21
Sonstige übertragbare Wertpapiere	k. A.	1,57
Zentral abgerechnete Finanzderivate	(0,16)	(0,02)
Freiverkehrsfinanzderivate	0,40	0,83
Einlagenzertifikate	0,70	0,06
Umgekehrte Pensionsgeschäfte	(1,43)	k. A.

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 30. Juni 2023 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	30. Jun. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
Chile	3,27	2,02
Kolumbien	3,86	3,54
Tschechische Republik	8,65	6,84
Dominikanische Republik	1,73	0,23
Deutschland	2,92	1,45
Ungarn	2,77	2,17
Indonesien	5,23	5,33
Israel	k. A.	2,52
Malaysia	9,65	8,58
Mexiko	8,10	5,26
Peru	4,51	2,20
Polen	5,13	2,47
Rumänien	2,62	4,38
Südafrika	6,66	10,65
Supranational	19,14	14,91
Thailand	6,66	4,28
Uruguay	1,19	1,12
Kurzfristige Instrumente	6,46	16,93
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Zinsswaps	(0,16)	(0,02)
Freiverkehrsfinanzderivate		
Optionskauf		
Devisenoptionen	0,23	0,09
Straddle-Optionen	0,00	k. A.
Verkaufsoptionen		
Devisenoptionen	(0,08)	0,00
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen - Schutzkauf	0,01	k. A.
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen - Schutzverkauf	k. A.	(0,09)
Zinsswaps	0,00	k. A.
Volatilitätsswaps	k. A.	0,00
Devisenterminkontrakte	0,24	0,83
Einlagenzertifikate	0,70	0,06
Sonstige Aktiva und Passiva	0,51	4,25
Nettovermögen	100,00	100,00

Aufstellung des Wertpapierbestands des Emerging Markets Bond Fund

BESCHREIBUNG		PARI (000S)		MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE					
ALBANIEN					
STAATSEMISSIONEN					
Albania Government International Bond					
3,500 % fällig am 23.11.2031	€	3.500	$	3.189	0,09
ANGOLA					
STAATSEMISSIONEN					
Angolan Government International Bond					
8,250 % fällig am 09.05.2028	$	15.400		13.703	0,40
8,750 % fällig am 14.04.2032		300		253	0,01
9,500 % fällig am 12.11.2025		400		392	0,01
Summe Angola				14.348	0,42
ARGENTINIEN					
STAATSEMISSIONEN					
Argentina Government International Bond					
0,500 % fällig am 09.07.2030		32.362		10.807	0,32
1,000 % fällig am 09.07.2029		13.237		4.328	0,13
1,500 % fällig am 09.07.2035		49.867		15.040	0,44
3,500 % fällig am 09.07.2041		48.955		15.764	0,46
3,875 % fällig am 09.01.2038		36.056		12.742	0,38
Provincia de Buenos Aires					
5,250 % fällig am 01.09.2037		5.000		1.919	0,06
Provincia de Cordoba					
6,875 % fällig am 10.12.2025 ^		1.909		1.441	0,04
Provincia de la Rioja					
6,500 % fällig am 24.02.2028 ^		6.321		3.381	0,10
Provincia de Neuquen					
6,625 % fällig am 27.04.2030 ^		2.210		1.570	0,05
Summe Argentinien				66.992	1,98
ASERBAIDSCHAN					
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL					
SOCAR Turkey Enerji AS Via Steas Funding DAC					
7,230 % fällig am 17.03.2026		12.500		12.219	0,36
Southern Gas Corridor CJSC					
6,875 % fällig am 24.03.2026		25.700		26.152	0,77
				38.371	1,13
STAATSEMISSIONEN					
Azerbaijan Government International Bond					
4,750 % fällig am 18.03.2024		908		899	0,03
Summe Aserbaidschan				39.270	1,16
BAHAMAS					
STAATSEMISSIONEN					
Bahamas Government International Bond					
6,000 % fällig am 21.11.2028		14.900		12.032	0,36
BAHRAIN					
STAATSEMISSIONEN					
Bahrain Government International Bond					
4,250 % fällig am 25.01.2028		11.500		10.636	0,31
5,625 % fällig am 30.09.2031		700		649	0,02
Summe Bahrain				11.285	0,33
BENIN					
STAATSEMISSIONEN					
Benin Government International Bond					
4,875 % fällig am 19.01.2032	€	4.150		3.447	0,10
BRASILIEN					
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL					
Banco do Brasil S.A.					
3,250 % fällig am 30.09.2026	$	2.700		2.492	0,07
Brazil Minas SPE Via State of Minas Gerais					
5,333 % fällig am 15.02.2028		21.945		21.556	0,64
CSN Inova Ventures					
6,750 % fällig am 28.01.2028		15.800		14.673	0,43
Odebrecht Oil & Gas Finance Ltd.					
0,000 % fällig am 31.07.2023 (d)(e)		14.563		38	0,00
Vale S.A.					
0,000 % (e)	BRL	188.860	$	12.039	0,36
				50.798	1,50
STAATSEMISSIONEN					
Brazil Government International Bond					
4,750 % fällig am 14.01.2050	$	4.700		3.472	0,10
Summe Brasilien				54.270	1,60
KAMERUN					
STAATSEMISSIONEN					
Republic of Cameroon Government International Bond					
5,950 % fällig am 07.07.2032	€	7.600		5.998	0,18
KANADA					
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL					
Frontera Energy Corp.					
7,875 % fällig am 21.06.2028	$	1.300		949	0,03
CAYMAN INSELN					
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL					
AAC Technologies Holdings, Inc.					
2,625 % fällig am 02.06.2026		4.600		4.032	0,12
Bioceanico Sovereign Certificate Ltd.					
0,000 % fällig am 05.06.2034 (d)		12.735		8.912	0,26
Country Garden Holdings Co. Ltd.					
2,700 % fällig am 12.07.2026		500		153	0,00
3,125 % fällig am 22.10.2025		400		126	0,00
5,400 % fällig am 27.05.2025		1.300		481	0,01
6,150 % fällig am 17.09.2025		900		297	0,01
Gaci First Investment Co.					
4,875 % fällig am 14.02.2035		1.300		1.248	0,04
5,000 % fällig am 13.10.2027		22.200		22.131	0,65
5,125 % fällig am 14.02.2053		15.600		14.060	0,42
Gran Tierra Energy International Holdings Ltd.					
6,250 % fällig am 15.02.2025		500		429	0,01
ICD Funding Ltd.					
3,223 % fällig am 28.04.2026		1.830		1.710	0,05
Interoceanica Finance Ltd.					
0,000 % fällig am 30.11.2025 (d)		573		528	0,02
0,000 % fällig am 15.05.2030 (d)		6.563		4.884	0,14
7,860 % fällig am 15.05.2030		3.543		3.365	0,10
Kaisa Group Holdings Ltd.					
8,500 % fällig am 30.06.2022 ^		600		40	0,00
9,375 % fällig am 30.06.2024 ^		4.100		273	0,01
9,750 % fällig am 28.09.2023 ^		3.200		214	0,01
11,250 % fällig am 09.04.2022 ^		1.100		74	0,00
11,500 % fällig am 30.01.2023 ^		200		13	0,00
11,700 % fällig am 11.11.2025 ^		3.300		221	0,01
11,950 % fällig am 12.11.2023 ^		2.600		211	0,01
KSA Sukuk Ltd.					
5,268 % fällig am 25.10.2028		12.300		12.575	0,37
Lima Metro Line Finance Ltd.					
4,350 % fällig am 05.04.2036		360		319	0,01
5,875 % fällig am 05.07.2034		1.037		1.009	0,03
New Metro Global Ltd.					
4,500 % fällig am 02.05.2026		3.400		1.437	0,04
6,800 % fällig am 05.08.2023		200		195	0,01
Nogaholding Sukuk Ltd.					
6,625 % fällig am 25.05.2033		3.700		3.699	0,11
Poinsettia Finance Ltd.					
6,625 % fällig am 17.06.2031		12.125		10.020	0,30
Seazen Group Ltd.					
4,450 % fällig am 13.07.2025		3.500		1.820	0,05
Sunac China Holdings Ltd.					
6,500 % fällig am 10.01.2025 ^		8.500		1.285	0,04
7,000 % fällig am 09.07.2025 ^		4.700		711	0,02
7,250 % fällig am 14.06.2022 ^		900		134	0,00
Tencent Holdings Ltd.					
3,840 % fällig am 22.04.2051		200		147	0,00
Zhongsheng Group Holdings Ltd.					
3,000 % fällig am 13.01.2026		3.900		3.557	0,11
Summe Cayman Inseln				100.310	2,96
CHILE					
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL					
Banco del Estado de Chile					
2,704 % fällig am 09.01.2025	$	4.300	$	4.116	0,12
Banco Santander Chile					
2,700 % fällig am 10.01.2025		5.200		4.977	0,15
Corp. Nacional del Cobre de Chile					
3,625 % fällig am 01.08.2027		6.700		6.331	0,19
4,500 % fällig am 01.08.2047		3.200		2.734	0,08
4,875 % fällig am 04.11.2044 (i)		5.600		5.062	0,15
5,125 % fällig am 02.02.2033		2.800		2.764	0,08
6,150 % fällig am 24.10.2036		1.000		1.088	0,03
Embotelladora Andina S.A.					
3,950 % fällig am 21.01.2050		3.900		3.040	0,09
Empresa de los Ferrocarriles del Estado					
3,068 % fällig am 18.08.2050		1.500		918	0,03
3,830 % fällig am 14.09.2061		7.000		4.777	0,14
Empresa de Transporte de Pasajeros Metro S.A.					
3,650 % fällig am 07.05.2030		1.600		1.468	0,04
Empresa Nacional del Petroleo					
3,450 % fällig am 16.09.2031		8.700		7.291	0,21
4,500 % fällig am 14.09.2047		3.000		2.260	0,07
6,150 % fällig am 10.05.2033		6.300		6.297	0,19
GNL Quintero S.A.					
4,634 % fällig am 31.07.2029		7.113		6.922	0,20
				60.045	1,77
STAATSEMISSIONEN					
Chile Government International Bond					
3,250 % fällig am 21.09.2071		11.900		7.750	0,23
3,625 % fällig am 30.10.2042 (i)		2.000		1.623	0,05
4,340 % fällig am 07.03.2042 (i)		13.000		11.573	0,34
4,950 % fällig am 05.01.2036 (a)		3.000		2.965	0,09
5,330 % fällig am 05.01.2054 (a)		1.600		1.592	0,04
				25.503	0,75
Summe Chile				85.548	2,52
CHINA					
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL					
Yango Justice International Ltd.					
7,500 % fällig am 15.04.2024 ^		4.700		99	0,00
ZhongAn Online P&C Insurance Co. Ltd.					
3,125 % fällig am 16.07.2025		9.500		8.407	0,25
Summe China				8.506	0,25
KOLUMBIEN					
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL					
Banco Davivienda S.A.					
6,650 % fällig am 22.04.2031 (e)(g)		900		663	0,02
Ecopetrol S.A.					
4,625 % fällig am 02.11.2031		9.800		7.574	0,22
5,375 % fällig am 26.06.2026		2.200		2.107	0,06
5,875 % fällig am 28.05.2045		3.100		2.127	0,06
6,875 % fällig am 29.04.2030		200		183	0,01
7,375 % fällig am 18.09.2043		2.400		2.004	0,06
				14.658	0,43
STAATSEMISSIONEN					
Colombia Government International Bond					
3,125 % fällig am 15.04.2031		15.507		11.731	0,35
3,875 % fällig am 15.02.2061 (i)		13.000		7.310	0,21
4,125 % fällig am 15.05.2051		13.700		8.233	0,24
4,500 % fällig am 28.01.2026		5.600		5.345	0,16
4,500 % fällig am 15.03.2029		400		351	0,01
5,000 % fällig am 15.06.2045		3.400		2.375	0,07
5,200 % fällig am 15.05.2049		12.700		8.757	0,26
5,625 % fällig am 26.02.2044		4.800		3.586	0,11
7,375 % fällig am 18.09.2037		1.400		1.334	0,04
7,500 % fällig am 02.02.2034		10.200		10.000	0,29
				59.022	1,74
Summe Kolumbien				73.680	2,17
COSTA RICA					
STAATSEMISSIONEN					
Costa Rica Government International Bond					
5,625 % fällig am 30.04.2043		3.000		2.585	0,08

BESCHREIBUNG		PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
DOMINIKANISCHE REPUBLIK				
STAATSEMISSIONEN				
Zentralbanknoten der Dominikanischen Republik				
12,000 % fällig am 03.10.2025	DOP	48.600	$ 924	0,03
13,000 % fällig am 05.12.2025		787.600	15.365	0,45
13,000 % fällig am 30.01.2026		292.600	5.724	0,17
Dominican Republic Government International Bond				
4,875 % fällig am 23.09.2032	$	6.200	5.293	0,16
5,300 % fällig am 21.01.2041		7.700	6.052	0,18
5,500 % fällig am 27.01.2025		9.600	9.461	0,28
5,500 % fällig am 22.02.2029		17.500	16.418	0,48
5,875 % fällig am 30.01.2060		7.650	5.947	0,18
5,950 % fällig am 25.01.2027		15.000	14.739	0,43
6,000 % fällig am 19.07.2028		12.400	12.116	0,36
6,000 % fällig am 22.02.2033		10.800	9.987	0,29
6,400 % fällig am 05.06.2049		250	214	0,01
6,875 % fällig am 29.01.2026		6.400	6.462	0,19
7,450 % fällig am 30.04.2044		100	98	0,00
13,625 % fällig am 03.02.2033	DOP	631.800	14.206	0,42
13,625 % fällig am 10.02.2034		489.000	11.168	0,33
Summe Dominikanische Republik			134.174	3,96
ECUADOR				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Ecuador Social Bond SARL				
0,000 % fällig am 30.01.2035 (d)	$	856	651	0,02
STAATSEMISSIONEN				
Ecuador Government International Bond				
0,000 % fällig am 31.07.2030 (d)		5.332	1.551	0,04
1,500 % fällig am 31.07.2040		22.463	7.043	0,21
2,500 % fällig am 31.07.2035		22.231	7.779	0,23
5,500 % fällig am 31.07.2030		16.626	8.083	0,24
			24.456	0,72
Summe Ecuador			25.107	0,74
ÄGYPTEN				
STAATSEMISSIONEN				
Egypt Government International Bond				
5,250 % fällig am 06.10.2025		6.000	4.583	0,13
5,625 % fällig am 16.04.2030	€	5.370	3.262	0,10
5,875 % fällig am 16.02.2031	$	5.900	3.264	0,10
6,375 % fällig am 11.04.2031	€	9.100	5.542	0,16
6,875 % fällig am 30.04.2040 (i)	$	3.100	1.691	0,05
7,053 % fällig am 15.01.2032		7.300	4.158	0,12
7,300 % fällig am 30.09.2033		15.700	8.687	0,26
7,500 % fällig am 16.02.2061		2.600	1.311	0,04
7,625 % fällig am 29.05.2032		11.100	6.477	0,19
7,903 % fällig am 21.02.2048		19.700	10.171	0,30
8,150 % fällig am 20.11.2059		2.100	1.093	0,03
8,500 % fällig am 31.01.2047		9.000	4.805	0,14
8,875 % fällig am 29.05.2050		12.300	6.662	0,20
Summe Ägypten			61.706	1,82
EL SALVADOR				
STAATSEMISSIONEN				
El Salvador Government International Bond				
6,375 % fällig am 18.01.2027		1.100	773	0,02
7,125 % fällig am 20.01.2050		12.707	7.102	0,21
7,625 % fällig am 21.09.2034		3.800	2.225	0,07
7,625 % fällig am 01.02.2041		530	304	0,01
7,650 % fällig am 15.06.2035		200	119	0,00
8,250 % fällig am 10.04.2032		2.610	1.691	0,05
8,625 % fällig am 28.02.2029		185	124	0,00
9,500 % fällig am 15.07.2052		1.400	888	0,03
Summe El Salvador			13.226	0,39
ÄTHIOPIEN				
STAATSEMISSIONEN				
Ethiopia Government International Bond				
6,625 % fällig am 11.12.2024		3.300	2.289	0,07

BESCHREIBUNG		PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
GABUN				
STAATSEMISSIONEN				
Gabon Government International Bond				
6,625 % fällig am 06.02.2031	$	400	$ 319	0,01
7,000 % fällig am 24.11.2031		400	319	0,01
Summe Gabun			638	0,02
GEORGIEN				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Georgian Railway JSC				
4,000 % fällig am 17.06.2028		300	260	0,01
GHANA				
STAATSEMISSIONEN				
Ghana Government International Bond				
6,375 % fällig am 11.02.2027 ^		11.100	4.817	0,14
7,625 % fällig am 16.05.2029 ^		800	345	0,01
7,750 % fällig am 07.04.2029 ^		7.600	3.272	0,09
7,875 % fällig am 11.02.2035 ^		4.029	1.763	0,05
8,125 % fällig am 26.03.2032 ^		6.100	2.636	0,08
8,625 % fällig am 07.04.2034 ^		8.500	3.662	0,11
8,750 % fällig am 11.03.2061 ^		1.750	729	0,02
8,875 % fällig am 07.05.2042 ^		1.600	662	0,02
8,950 % fällig am 26.03.2051 ^		4.600	1.929	0,06
Summe Ghana			19.815	0,58
GUATEMALA				
STAATSEMISSIONEN				
Guatemala Government International Bond				
4,375 % fällig am 05.06.2027		8.600	8.152	0,24
4,500 % fällig am 03.05.2026		6.900	6.605	0,19
4,650 % fällig am 07.10.2041		800	642	0,02
4,875 % fällig am 13.02.2028		7.120	6.790	0,20
5,375 % fällig am 24.04.2032		300	286	0,01
6,600 % fällig am 13.06.2036		7.400	7.455	0,22
Summe Guatemala			29.930	0,88
HONGKONG				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
AIA Group Ltd.				
3,200 % fällig am 16.09.2040		900	691	0,02
Fortune Star BVI Ltd.				
3,950 % fällig am 02.10.2026	€	3.000	2.258	0,07
5,000 % fällig am 18.05.2026	$	200	150	0,00
5,050 % fällig am 27.01.2027		1.300	900	0,03
6,850 % fällig am 02.07.2024		2.200	1.986	0,06
Huarong Finance Co. Ltd.				
3,875 % fällig am 13.11.2029		300	232	0,01
4,500 % fällig am 29.05.2029		3.650	2.929	0,08
5,000 % fällig am 19.11.2025		3.700	3.417	0,10
5,500 % fällig am 16.01.2025		200	190	0,01
			12.753	0,38
STAATSEMISSIONEN				
Airport Authority Hong Kong				
2,100 % fällig am 08.03.2026 (e)		7.500	6.864	0,20
2,625 % fällig am 04.02.2051		1.000	695	0,02
4,875 % fällig am 12.01.2030		9.400	9.559	0,28
Hong Kong Government International Bond				
3,750 % fällig am 07.06.2032	€	7.700	8.461	0,25
			25.579	0,75
Summe Hongkong			38.332	1,13
UNGARN				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
MVM Energetika Zrt				
7,500 % fällig am 09.06.2028	$	5.600	5.591	0,16
STAATSEMISSIONEN				
Ungarische Entwicklungsbank				
6,500 % fällig am 29.06.2028		15.300	15.174	0,45
Hungary Government International Bond				
0,500 % fällig am 18.11.2030	€	800	637	0,02
1,625 % fällig am 28.04.2032		1.418	1.178	0,03
2,125 % fällig am 22.09.2031	$	2.700	2.093	0,06

BESCHREIBUNG		PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
3,125 % fällig am 21.09.2051	$	2.500	$ 1.560	0,05
5,250 % fällig am 16.06.2029		16.800	16.382	0,48
5,500 % fällig am 16.06.2034		700	681	0,02
6,250 % fällig am 22.09.2032		8.000	8.216	0,24
6,750 % fällig am 25.09.2052		3.500	3.620	0,11
7,625 % fällig am 29.03.2041		5.000	5.650	0,17
Magyar Export-Import Bank				
6,125 % fällig am 04.12.2027		10.600	10.498	0,31
			65.689	1,94
Summe Ungarn			71.280	2,10
INDIEN				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
NTPC Ltd.				
3,750 % fällig am 03.04.2024		2.000	1.967	0,06
Reliance Industries Ltd.				
2,875 % fällig am 12.01.2032		2.400	2.003	0,06
			3.970	0,12
STAATSEMISSIONEN				
Export-Import Bank of India				
3,375 % fällig am 05.08.2026		600	565	0,01
3,875 % fällig am 12.03.2024		4.100	4.035	0,12
			4.600	0,13
Summe Indien			8.570	0,25
INDONESIEN				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Indonesia Asahan Aluminium PT				
5,450 % fällig am 15.05.2030		8.000	7.764	0,23
5,800 % fällig am 15.05.2050		3.000	2.650	0,08
LLPL Capital Pte. Ltd.				
6,875 % fällig am 04.02.2039		910	818	0,02
Pelabuhan Indonesia Persero PT				
4,250 % fällig am 05.05.2025		6.500	6.344	0,19
4,875 % fällig am 01.10.2024		3.100	3.072	0,09
5,375 % fällig am 05.05.2045		3.693	3.486	0,10
Pertamina Persero PT				
1,400 % fällig am 09.02.2026		600	543	0,01
4,175 % fällig am 21.01.2050		5.000	3.951	0,12
5,625 % fällig am 20.05.2043		1.800	1.737	0,05
6,000 % fällig am 03.05.2042		21.100	21.238	0,63
6,450 % fällig am 30.05.2044		12.400	12.894	0,38
6,500 % fällig am 07.11.2048		9.500	9.892	0,29
Perusahaan Perseroan Persero PT Perusahaan Listrik Negara				
4,000 % fällig am 30.06.2050		16.800	12.024	0,35
4,125 % fällig am 15.05.2027		6.300	6.006	0,18
4,375 % fällig am 05.02.2050		2.900	2.185	0,06
5,250 % fällig am 24.10.2042		2.300	2.055	0,06
5,250 % fällig am 15.05.2047		8.400	7.382	0,22
6,150 % fällig am 21.05.2048		2.700	2.613	0,08
6,250 % fällig am 25.01.2049		7.800	7.689	0,23
			114.343	3,37
STAATSEMISSIONEN				
Indonesia Government International Bond				
1,100 % fällig am 12.03.2033	€	8.400	6.823	0,20
4,750 % fällig am 18.07.2047	$	2.700	2.552	0,08
5,350 % fällig am 11.02.2049		200	203	0,01
5,650 % fällig am 11.01.2053		800	839	0,02
6,625 % fällig am 17.02.2037		5.900	6.747	0,20
6,750 % fällig am 15.01.2044		4.000	4.692	0,14
7,750 % fällig am 17.01.2038		1.000	1.252	0,04
Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia				
3,800 % fällig am 23.06.2050		7.000	5.541	0,16
			28.649	0,85
Summe Indonesien			142.992	4,22
INTERNATIONALE KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG				
Project Mercury				
TBD % fällig am 17.07.2030	€	6.700	7.310	0,21
Staatliche Energiegesellschaft der Republik Aserbaidschan				
TBD % fällig am 26.11.2024	$	1.000	975	0,03
Summe International			8.285	0,24

BESCHREIBUNG		PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
IRLAND				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Alfa Bank AO Via Alfa Bond Issuance PLC				
5,950 % fällig am 15.04.2030 ^(g)	$	6.600	$ 396	0,01
Angola Via Avenir Issuer Ireland DAC				
6,927 % fällig am 19.02.2027		22.646	21.287	0,63
Russian Railways Via RZD Capital PLC				
7,487 % fällig am 25.03.2031 ^	£	500	494	0,01
Saderea DAC				
12,500 % fällig am 30.11.2026 ^	$	6.199	2.635	0,08
Summe Irland			24.812	0,73
ISRAEL				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Bank Hapoalim B.M.				
3,255 % fällig am 21.01.2032 (g)		9.900	8.511	0,25
Israel Electric Corp. Ltd.				
4,250 % fällig am 14.08.2028		5.400	5.041	0,15
5,000 % fällig am 12.11.2024		200	198	0,01
Leviathan Bond Ltd.				
6,125 % fällig am 30.06.2025		2.100	2.058	0,06
6,500 % fällig am 30.06.2027		6.800	6.528	0,19
			22.336	0,66
STAATSEMISSIONEN				
Israel Government International Bond				
0,150 % fällig am 31.07.2023	ILS	23.700	6.363	0,19
1,500 % fällig am 30.11.2023		149.700	39.832	1,17
			46.195	1,36
Summe Israel			68.531	2,02
ELFENBEINKÜSTE				
KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG				
Elfenbeinküste				
7,985 % fällig am 19.03.2027	€	3.440	3.659	0,11
STAATSEMISSIONEN				
Ivory Coast Government International Bond				
4,875 % fällig am 30.01.2032		6.700	5.710	0,17
5,250 % fällig am 22.03.2030		500	462	0,01
5,875 % fällig am 17.10.2031		2.400	2.198	0,06
6,625 % fällig am 22.03.2048		300	233	0,01
			8.603	0,25
Summe Elfenbeinküste			12.262	0,36
JAMAIKA				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
TransJamaican Highway Ltd.				
5,750 % fällig am 10.10.2036	$	3.273	2.706	0,08
JAPAN				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc.				
5,063 % fällig am 12.09.2025		16.500	16.308	0,48
JERSEY, KANALINSELN				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Corsair International Ltd.				
7,772 % fällig am 28.01.2027	€	15.900	17.260	0,51
8,122 % fällig am 28.01.2029		6.900	7.472	0,22
Summe Jersey, Kanalinseln			24.732	0,73
JORDANIEN				
STAATSEMISSIONEN				
Jordan Government International Bond				
4,950 % fällig am 07.07.2025	$	2.200	2.134	0,06
5,750 % fällig am 31.01.2027		13.200	12.705	0,38
5,850 % fällig am 07.07.2030		2.100	1.930	0,06
6,125 % fällig am 29.01.2026		6.250	6.144	0,18
7,375 % fällig am 10.10.2047		700	605	0,02
7,500 % fällig am 13.01.2029		6.100	6.149	0,18
Summe Jordanien			29.667	0,88

BESCHREIBUNG		PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
KASACHSTAN				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
KazMunayGas National Co. JSC				
3,500 % fällig am 14.04.2033	$	1.300	$ 1.010	0,03
4,750 % fällig am 19.04.2027		16.600	15.781	0,47
5,375 % fällig am 24.04.2030		1.200	1.116	0,03
5,750 % fällig am 19.04.2047		15.490	12.639	0,37
6,375 % fällig am 24.10.2048		4.300	3.686	0,11
Tengizchevroil Finance Co. International Ltd.				
3,250 % fällig am 15.08.2030		5.400	4.136	0,12
Summe Kasachstan			38.368	1,13
KENIA				
STAATSEMISSIONEN				
Kenya Government International Bond				
6,875 % fällig am 24.06.2024		3.750	3.576	0,11
8,000 % fällig am 22.05.2032		1.300	1.102	0,03
Summe Kenia			4.678	0,14
LIBANON				
STAATSEMISSIONEN				
Lebanon Government International Bond				
8,250 % fällig am 17.05.2034 ^		9.700	653	0,02
		AKTIEN		
LUXEMBURG				
STAMMAKTIEN				
DrillCo Holding Lux S.A. (c)		143.033	2.746	0,08
DrillCo Holding Lux S.A. (c)(h)		364.034	6.989	0,21
Summe Stammaktien			$ 9.735	0,29
		PARI (000S)		
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Constellation Oil Services Holding S.A.				
13,500 % fällig am 30.06.2025	$	1.704	1.682	0,05
Constellation Oil Services Holding S.A. (3,000 % bar und 4,000 % PIK)				
3,000 % fällig am 31.12.2026 (b)		3.855	2.281	0,07
FORESEA Holding S.A.				
7,500 % fällig am 15.06.2030		6.316	5.578	0,16
Greensaif Pipelines Bidco SARL				
6,129 % fällig am 23.02.2038		4.700	4.808	0,14
6,510 % fällig am 23.02.2042		4.600	4.787	0,14
Guara Norte SARL				
5,198 % fällig am 15.06.2034		12.380	10.854	0,32
Petrorio Luxembourg Trading SARL				
6,125 % fällig am 09.06.2026		7.100	6.827	0,20
TMS Issuer SARL				
5,780 % fällig am 23.08.2032		6.600	6.809	0,20
Unigel Luxembourg S.A.				
8,750 % fällig am 01.10.2026		3.900	1.282	0,04
			44.908	1,32
Summe Luxemburg			54.643	1,61
MAZEDONIEN				
STAATSEMISSIONEN				
North Macedonia Government International Bond				
6,960 % fällig am 13.03.2027	€	7.600	8.475	0,25
MALAYSIA				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Axiata SPV2 Bhd.				
2,163 % fällig am 19.08.2030	$	1.900	1.616	0,05
Khazanah Capital Ltd.				
4,876 % fällig am 01.06.2033		6.100	6.043	0,18
Khazanah Global Sukuk Bhd.				
4,687 % fällig am 01.06.2028		8.200	8.094	0,24
Petronas Capital Ltd.				
4,500 % fällig am 18.03.2045		500	460	0,01
4,550 % fällig am 21.04.2050		9.700	8.919	0,26
			25.132	0,74

BESCHREIBUNG		PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
STAATSEMISSIONEN				
Malaysia Government International Bond				
3,800 % fällig am 17.08.2023	MYR	107.200	$ 22.986	0,68
Summe Malaysia			48.118	1,42
MAURITIUS				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Greenko Solar Mauritius Ltd.				
5,950 % fällig am 29.07.2026	$	200	188	0,01
		AKTIEN		
MEXIKO				
STAMMAKTIEN				
Hipotecaria Su Casita S.A. (c)		39.443	0	0,00
Urbi Desarrollos Urbanos S.A.B. de C.V. (c)		2.622	1	0,00
Summe Stammaktien			1	0,00
		PARI (000S)		
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Banco Mercantil del Norte S.A.				
6,625 % fällig am 24.01.2032 (e)(g)	$	4.100	3.173	0,09
6,750 % fällig am 27.09.2024 (e)(g)		3.000	2.885	0,09
7,500 % fällig am 27.06.2029 (e)(g)		5.400	4.694	0,14
Comision Federal de Electricidad				
6,264 % fällig am 15.02.2052		5.700	4.807	0,14
Corp. GEO S.A.B. de C.V.				
8,875 % fällig am 25.09.2014 ^		13.920	0	0,00
9,250 % fällig am 30.06.2020 ^		1.000	0	0,00
Industrias Penoles S.A.B. de C.V.				
4,750 % fällig am 06.08.2050		3.900	3.109	0,09
Petroleos Mexicanos				
3,625 % fällig am 24.11.2025	€	1.400	1.398	0,04
4,875 % fällig am 21.02.2028		1.300	1.178	0,04
5,812 % fällig am 24.08.2023		6.500	7.069	0,21
6,350 % fällig am 12.02.2048	$	30.367	18.396	0,54
6,500 % fällig am 02.06.2041		2.000	1.272	0,04
6,625 % fällig am 15.06.2035		9.350	6.528	0,19
6,625 % fällig am 15.06.2038		200	134	0,00
6,700 % fällig am 16.02.2032		12.558	9.560	0,28
6,750 % fällig am 21.09.2047		17.180	10.804	0,32
6,840 % fällig am 23.01.2030		278	221	0,01
6,950 % fällig am 28.01.2060		29.647	18.515	0,55
7,690 % fällig am 23.01.2050		66.636	45.222	1,33
10,000 % fällig am 07.02.2033		1.000	917	0,03
10,000 % fällig am 07.02.2033 (i)		8.950	8.206	0,24
Sitios Latinoamerica S.A.B. de C.V.				
5,375 % fällig am 04.04.2032 (i)		7.250	6.573	0,19
			154.661	4,56
STAATSEMISSIONEN				
Mexico Government International Bond				
3,750 % fällig am 19.04.2071		9.200	6.160	0,18
3,771 % fällig am 24.05.2061		15.400	10.509	0,31
5,000 % fällig am 27.04.2051 (i)		14.100	12.261	0,36
5,400 % fällig am 09.02.2028		9.500	9.683	0,29
5,750 % fällig am 12.10.2110		43.450	38.884	1,15
6,338 % fällig am 04.05.2053		8.685	8.869	0,26
6,350 % fällig am 09.02.2035		16.400	17.282	0,51
			103.648	3,06
Summe Mexiko			258.310	7,62
MAROKKO				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
OCP S.A.				
3,750 % fällig am 23.06.2031		10.850	9.001	0,27
5,125 % fällig am 23.06.2051		4.300	3.144	0,09
Summe Marokko			12.145	0,36

BESCHREIBUNG		PARI (000S)		MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
MULTINATIONAL					
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL					
ATP Tower Holdings LLC					
4,050 % fällig am 27.04.2026	$	10.600	$	9.126	0,27
NAMIBIA					
STAATSEMISSIONEN					
Namibia Government International Bond					
5,250 % fällig am 29.10.2025		6.000		5.712	0,17
NIEDERLANDE					
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL					
Metinvest BV					
8,500 % fällig am 23.04.2026		5.700		3.933	0,12
Prosus NV					
1,539 % fällig am 03.08.2028	€	2.400		2.159	0,06
2,031 % fällig am 03.08.2032		1.200		933	0,03
3,257 % fällig am 19.01.2027	$	3.900		3.527	0,10
3,832 % fällig am 08.02.2051		2.100		1.291	0,04
4,027 % fällig am 03.08.2050		1.600		1.006	0,03
Angola Via Avenir BV					
10,163 % fällig am 07.12.2023		2.533		2.520	0,07
12,772 % fällig am 03.07.2023		4.916		4.916	0,15
Summe Niederlande				20.285	0,60
NIGERIA					
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL					
BOI Finance BV					
7,500 % fällig am 16.02.2027	€	14.400		13.569	0,40
STAATSEMISSIONEN					
Nigeria Government International Bond					
6,125 % fällig am 28.09.2028	$	6.800		5.680	0,17
6,375 % fällig am 12.07.2023		8.650		8.633	0,25
6,500 % fällig am 28.11.2027		5.844		5.107	0,15
7,143 % fällig am 23.02.2030		7.000		5.886	0,17
7,375 % fällig am 28.09.2033		7.400		5.845	0,17
7,625 % fällig am 28.11.2047		9.846		7.028	0,21
7,696 % fällig am 23.02.2038		4.800		3.609	0,11
7,875 % fällig am 16.02.2032		5.000		4.206	0,12
8,250 % fällig am 28.09.2051		4.400		3.297	0,10
8,375 % fällig am 24.03.2029		2.600		2.347	0,07
				51.638	1,52
Summe Nigeria				65.207	1,92
OMAN					
STAATSEMISSIONEN					
Oman Government International Bond					
4,875 % fällig am 01.02.2025		1.100		1.084	0,03
5,625 % fällig am 17.01.2028		6.690		6.630	0,19
6,000 % fällig am 01.08.2029		16.100		16.137	0,48
6,250 % fällig am 25.01.2031		7.700		7.827	0,23
6,500 % fällig am 08.03.2047		3.473		3.247	0,10
6,750 % fällig am 28.10.2027		13.300		13.764	0,41
6,750 % fällig am 17.01.2048		3.900		3.757	0,11
7,000 % fällig am 25.01.2051		2.400		2.382	0,07
Summe Oman				54.828	1,62
PAKISTAN					
STAATSEMISSIONEN					
Pakistan Government International Bond					
6,000 % fällig am 08.04.2026		3.952		1.936	0,06
6,875 % fällig am 05.12.2027		3.500		1.680	0,05
7,375 % fällig am 08.04.2031		3.870		1.790	0,05
8,250 % fällig am 15.04.2024		2.500		1.812	0,05
8,875 % fällig am 08.04.2051		10.500		4.694	0,14
Summe Pakistan				11.912	0,35
PANAMA					
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL					
Aeropuerto Internacional de Tocumen S.A.					
5,125 % fällig am 11.08.2061		7.100		5.481	0,16
Banco General S.A.					
5,250 % fällig am 07.05.2031 (e)(g)		400		346	0,01
5,250 % fällig am 07.05.2031 (e)		8.300		7.176	0,21
Banco Nacional de Panamá					
2,500 % fällig am 11.08.2030	$	5.900	$	4.648	0,14
				17.651	0,52
STAATSEMISSIONEN					
Panama Government International Bond					
3,870 % fällig am 23.07.2060		1.400		931	0,03
4,300 % fällig am 29.04.2053		9.900		7.392	0,22
4,500 % fällig am 15.05.2047		6.100		4.867	0,14
4,500 % fällig am 16.04.2050		6.600		5.131	0,15
4,500 % fällig am 01.04.2056		3.400		2.562	0,07
4,500 % fällig am 19.01.2063		8.200		6.020	0,18
6,400 % fällig am 14.02.2035		13.900		14.530	0,43
6,700 % fällig am 26.01.2036		1.300		1.395	0,04
6,853 % fällig am 28.03.2054		3.900		4.067	0,12
8,125 % fällig am 28.04.2034		300		355	0,01
8,875 % fällig am 30.09.2027		1.700		1.955	0,06
				49.205	1,45
Summe Panama				66.856	1,97
PARAGUAY					
STAATSEMISSIONEN					
Paraguay Government International Bond					
2,739 % fällig am 29.01.2033		1.900		1.524	0,04
3,849 % fällig am 28.06.2033		2.600		2.263	0,07
4,700 % fällig am 27.03.2027		1.800		1.753	0,05
5,400 % fällig am 30.03.2050		4.400		3.770	0,11
5,850 % fällig am 21.08.2033 (a)		3.600		3.606	0,11
6,100 % fällig am 11.08.2044		2.400		2.278	0,07
Summe Paraguay				15.194	0,45
PERU					
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL					
Banco de Credito del Peru S.A.					
4,650 % fällig am 17.09.2024	PEN	26.100		6.904	0,20
InRetail Consumer					
3,250 % fällig am 22.03.2028	$	6.300		5.416	0,16
Peru LNG SRL					
5,375 % fällig am 22.03.2030		6.974		5.620	0,17
Petroleos del Peru S.A.					
4,750 % fällig am 19.06.2032		2.600		1.990	0,06
5,625 % fällig am 19.06.2047		17.869		11.542	0,34
				31.472	0,93
STAATSEMISSIONEN					
Peru Government International Bond					
3,230 % fällig am 28.07.2121		1.900		1.155	0,04
3,600 % fällig am 15.01.2072		2.600		1.779	0,05
6,550 % fällig am 14.03.2037		14.243		16.013	0,47
8,750 % fällig am 21.11.2033		785		998	0,03
				19.945	0,59
Summe Peru				51.417	1,52
PHILIPPINEN					
STAATSEMISSIONEN					
Philippines Government International Bond					
2,650 % fällig am 10.12.2045		7.400		4.996	0,15
2,950 % fällig am 05.05.2045		1.600		1.142	0,03
3,700 % fällig am 01.03.2041		650		536	0,02
5,000 % fällig am 17.07.2033		7.200		7.300	0,22
6,375 % fällig am 23.10.2034		847		947	0,03
9,500 % fällig am 02.02.2030		4.179		5.246	0,15
Summe Philippinen				20.167	0,60
POLEN					
STAATSEMISSIONEN					
Bank Gospodarstwa Krajowego					
5,375 % fällig am 22.05.2033		5.600		5.578	0,16
Poland Government International Bond					
4,875 % fällig am 04.10.2033		8.500		8.359	0,25
5,500 % fällig am 16.11.2027		10.250		10.531	0,31
5,500 % fällig am 04.04.2053		9.500		9.585	0,28
Summe Polen				34.053	1,00
KATAR					
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL					
QatarEnergy					
2,250 % fällig am 12.07.2031	$	9.100	$	7.644	0,23
3,125 % fällig am 12.07.2041		27.350		20.985	0,62
3,300 % fällig am 12.07.2051		42.300		31.136	0,92
Ras Laffan Liquefied Natural Gas Co. Ltd.					
5,838 % fällig am 30.09.2027		1.133		1.148	0,03
6,332 % fällig am 30.09.2027		294		300	0,01
				61.213	1,81
STAATSEMISSIONEN					
Qatar Government International Bond					
4,400 % fällig am 16.04.2050		5.800		5.289	0,16
4,625 % fällig am 02.06.2046		300		286	0,01
4,817 % fällig am 14.03.2049		1.800		1.733	0,05
5,103 % fällig am 23.04.2048		480		479	0,01
				7.787	0,23
Summe Katar				69.000	2,04
RUMÄNIEN					
STAATSEMISSIONEN					
Romania Government International Bond					
1,750 % fällig am 13.07.2030	€	12.000		10.009	0,30
2,000 % fällig am 08.12.2026		3.900		3.892	0,11
2,124 % fällig am 16.07.2031 (i)		1.000		830	0,02
2,125 % fällig am 07.03.2028		4.700		4.461	0,13
2,375 % fällig am 19.04.2027		1.750		1.745	0,05
2,625 % fällig am 02.12.2040		7.400		4.929	0,15
2,875 % fällig am 13.04.2042		3.400		2.286	0,07
3,500 % fällig am 03.04.2034		4.200		3.653	0,11
3,750 % fällig am 07.02.2034		3.155		2.789	0,08
3,875 % fällig am 29.10.2035		100		87	0,00
4,000 % fällig am 14.02.2051	$	2.700		1.934	0,06
4,125 % fällig am 11.03.2039	€	1.000		852	0,02
4,625 % fällig am 03.04.2049		5.600		4.725	0,14
5,000 % fällig am 27.09.2026		15.000		16.444	0,48
6,125 % fällig am 22.01.2044	$	4.050		3.915	0,12
7,625 % fällig am 17.01.2053		9.500		10.466	0,31
Summe Rumänien				73.017	2,15
RUSSLAND					
STAATSEMISSIONEN					
Russia Government International Bond					
1,125 % fällig am 20.11.2027 ^	€	500		256	0,01
1,850 % fällig am 20.11.2032 ^		8.900		4.564	0,14
4,250 % fällig am 23.06.2027 ^	$	800		348	0,01
4,375 % fällig am 21.03.2029 ^		5.000		2.225	0,07
4,750 % fällig am 27.05.2026 ^		400		202	0,01
5,100 % fällig am 28.03.2035 ^		3.400		1.513	0,04
5,250 % fällig am 23.06.2047 ^		1.400		84	0,00
5,250 % fällig am 23.06.2047 ^		200		89	0,00
7,500 % fällig am 31.03.2030 ^		174		115	0,00
Summe Russland				9.396	0,28
SAUDI-ARABIEN					
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL					
Saudi Arabian Oil Co.					
2,250 % fällig am 24.11.2030		4.500		3.751	0,11
2,875 % fällig am 16.04.2024		600		586	0,02
3,500 % fällig am 16.04.2029		3.000		2.768	0,08
3,500 % fällig am 24.11.2070		45.000		29.997	0,89
				37.102	1,10
STAATSEMISSIONEN					
Saudi Arabia Government International Bond					
2,250 % fällig am 02.02.2033		2.000		1.614	0,05
3,250 % fällig am 22.10.2030		2.000		1.817	0,05
3,450 % fällig am 02.02.2061		9.900		6.981	0,21
3,750 % fällig am 21.01.2055		8.600		6.521	0,19
4,500 % fällig am 26.10.2046 (i)		26.600		23.367	0,69
4,625 % fällig am 04.10.2047		300		268	0,01
4,750 % fällig am 18.01.2028		35.900		35.637	1,05
4,875 % fällig am 18.07.2033		37.400		37.408	1,10
				113.613	3,35
Summe Saudi-Arabien				150.715	4,45

BESCHREIBUNG		PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
SENEGAL				
STAATSEMISSIONEN				
Senegal Government International Bond				
4,750 % fällig am 13.03.2028	€	3.400	$ 3.204	0,09
5,375 % fällig am 08.06.2037		6.300	4.614	0,13
6,250 % fällig am 23.05.2033	$	7.950	6.676	0,20
6,750 % fällig am 13.03.2048		800	575	0,02
Summe Senegal			15.069	0,44
SERBIEN				
STAATSEMISSIONEN				
Serbia Government International Bond				
1,000 % fällig am 23.09.2028	€	1.500	1.270	0,04
1,500 % fällig am 26.06.2029		7.400	6.250	0,19
1,650 % fällig am 03.03.2033		14.500	10.557	0,31
2,050 % fällig am 23.09.2036		4.100	2.751	0,08
3,125 % fällig am 15.05.2027		2.700	2.650	0,08
6,500 % fällig am 26.09.2033	$	11.450	11.257	0,33
Summe Serbien			34.735	1,03
SINGAPUR				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Flex Ltd.				
4,875 % fällig am 15.06.2029		1.300	1.244	0,04
Medco Bell Pte. Ltd.				
6,375 % fällig am 30.01.2027		8.400	7.871	0,23
Singapore Airlines Ltd.				
3,375 % fällig am 19.01.2029		9.800	9.009	0,27
Summe Singapur			18.124	0,54
SÜDAFRIKA				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
AngloGold Ashanti Holdings PLC				
3,750 % fällig am 01.10.2030		3.600	3.093	0,09
6,500 % fällig am 15.04.2040		200	202	0,01
Entwicklungsbank für das südliche Afrika				
8,600 % fällig am 21.10.2024 (h)	ZAR	467.300	24.311	0,72
Eskom Holdings SOC Ltd.				
4,314 % fällig am 23.07.2027	$	13.650	12.098	0,36
6,350 % fällig am 10.08.2028		14.400	13.447	0,39
6,750 % fällig am 06.08.2023		400	399	0,01
8,450 % fällig am 10.08.2028		13.200	12.573	0,37
Sasol Financing USA LLC				
5,875 % fällig am 27.03.2024		5.815	5.745	0,17
8,750 % fällig am 03.05.2029		8.300	8.094	0,24
			79.962	2,36
STAATSEMISSIONEN				
South Africa Government International Bond				
4,300 % fällig am 12.10.2028		2.400	2.126	0,06
4,850 % fällig am 30.09.2029		11.100	9.786	0,29
5,000 % fällig am 12.10.2046		10.200	6.813	0,20
5,375 % fällig am 24.07.2044		400	285	0,01
5,750 % fällig am 30.09.2049		6.400	4.546	0,13
7,300 % fällig am 20.04.2052		5.300	4.469	0,13
10,500 % fällig am 21.12.2026 (i)	ZAR	798.000	43.870	1,30
10,500 % fällig am 21.12.2026		123.000	6.762	0,20
			78.657	2,32
Summe Südafrika			158.619	4,68
SÜDKOREA				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Kodit Global Co. Ltd.				
4,954 % fällig am 25.05.2026	$	1.700	1.674	0,05
SK on Co. Ltd.				
5,375 % fällig am 11.05.2026		4.900	4.861	0,14
			6.535	0,19
STAATSEMISSIONEN				
Korea National Oil Corp.				
4,875 % fällig am 03.04.2028		16.100	15.951	0,47
Summe Südkorea			22.486	0,66

BESCHREIBUNG		PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
SPANIEN				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Banco Santander S.A.				
5,147 % fällig am 18.08.2025	$	13.600	$ 13.364	0,39
SRI LANKA				
STAATSEMISSIONEN				
Sri Lanka Government International Bond				
5,750 % fällig am 18.04.2023 ^		8.170	3.727	0,11
5,875 % fällig am 25.07.2022 ^		2.050	954	0,03
6,125 % fällig am 03.06.2025 ^		5.100	2.433	0,07
6,200 % fällig am 11.05.2027 ^		8.700	4.005	0,12
6,350 % fällig am 28.06.2024 ^		500	230	0,01
6,825 % fällig am 18.07.2026 ^		1.200	569	0,01
6,850 % fällig am 14.03.2024 ^		200	92	0,00
6,850 % fällig am 03.11.2025 ^		6.500	3.097	0,09
7,550 % fällig am 28.03.2030 ^		18.400	8.471	0,25
7,850 % fällig am 14.03.2029 ^		4.200	1.934	0,06
Summe Sri Lanka			25.512	0,75
SUPRANATIONAL				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Eastern & Southern African Trade & Development Bank				
4,125 % fällig am 30.06.2028		8.300	6.553	0,19
STAATSEMISSIONEN				
Ghana Government International Bond				
10,750 % fällig am 14.10.2030 ^		1.050	710	0,02
Summe Supranational			7.263	0,21
SCHWEIZ				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Credit Suisse AG				
4,750 % fällig am 09.08.2024		6.000	5.866	0,18
UBS Group AG				
2,593 % fällig am 11.09.2025		1.100	1.049	0,03
6,373 % fällig am 15.07.2026		4.500	4.473	0,13
Summe Schweiz			11.388	0,34
TANSANIA				
KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG				
The Ministry of Finance and Planning, Government of the United Republic of Tanzania				
9,048 % fällig am 26.04.2028	€	11.182	12.032	0,36
THAILAND				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Bangkok Bank PCL				
3,733 % fällig am 25.09.2034 (g)	$	800	679	0,02
PTTEP Treasury Center Co. Ltd.				
2,587 % fällig am 10.06.2027		1.300	1.183	0,04
Summe Thailand			1.862	0,06
TUNESIEN				
STAATSEMISSIONEN				
Banque Centrale de Tunisie Government International Bond				
3,280 % fällig am 09.08.2027	¥	200.000	658	0,02
5,625 % fällig am 17.02.2024	€	4.100	3.721	0,11
5,750 % fällig am 30.01.2025 (i)	$	2.800	1.873	0,06
6,750 % fällig am 31.10.2023	€	1.700	1.727	0,05
Summe Tunesien			7.979	0,24
TÜRKEI				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Turkish Airlines Pass-Through Trust				
4,200 % fällig am 15.09.2028	$	4.518	4.163	0,12
Turkiye Is Bankasi A/S				
6,125 % fällig am 25.04.2024		2.200	2.161	0,06
Yapi ve Kredi Bankasi A/S				
5,850 % fällig am 21.06.2024		600	585	0,02
			6.909	0,20

BESCHREIBUNG		PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG				
SOCAR Turkey Enerji A/S				
6,553 % fällig am 11.08.2026	€	19.884	$ 21.043	0,62
STAATSEMISSIONEN				
Export-Credit Bank of Turkey				
5,750 % fällig am 06.07.2026	$	3.500	3.170	0,09
Turkey Government International Bond				
4,875 % fällig am 09.10.2026		6.000	5.368	0,16
4,875 % fällig am 16.04.2043		7.500	4.833	0,14
5,125 % fällig am 17.02.2028		22.300	19.448	0,57
5,750 % fällig am 11.05.2047		59.500	40.807	1,21
5,950 % fällig am 15.01.2031		22.000	18.614	0,55
6,000 % fällig am 14.01.2041		18.635	13.772	0,41
6,125 % fällig am 24.10.2028		5.200	4.659	0,14
6,875 % fällig am 17.03.2036		17.970	15.255	0,45
9,125 % fällig am 13.07.2030		12.000	11.925	0,35
9,875 % fällig am 15.01.2028		10.900	11.130	0,33
			148.981	4,40
Summe Türkei			176.933	5,22
UKRAINE				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
NPC Ukrenergo				
6,875 % fällig am 09.11.2028 ^		7.800	1.677	0,05
STAATSEMISSIONEN				
Ukraine Government International Bond				
4,375 % fällig am 27.01.2032 ^	€	5.200	1.240	0,04
6,876 % fällig am 21.05.2031 ^	$	2.400	554	0,02
7,253 % fällig am 15.03.2035 ^		11.139	2.596	0,08
7,375 % fällig am 25.09.2034 ^		5.020	1.178	0,03
7,750 % fällig am 01.09.2026 ^		5.000	1.218	0,03
7,750 % fällig am 01.09.2027 ^		6.000	1.448	0,04
			8.234	0,24
Summe Ukraine			9.911	0,29
VEREINIGTE ARABISCHE EMIRATE				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Abu Dhabi Crude Oil Pipeline LLC				
3,650 % fällig am 02.11.2029		4.200	3.979	0,12
4,600 % fällig am 02.11.2047		5.600	5.209	0,15
Abu Dhabi National Energy Co. PJSC				
4,375 % fällig am 24.01.2029		6.500	6.430	0,19
4,696 % fällig am 24.04.2033		5.500	5.476	0,16
DP World Ltd.				
4,700 % fällig am 30.09.2049		1.800	1.524	0,04
5,625 % fällig am 25.09.2048		3.475	3.253	0,09
6,850 % fällig am 02.07.2037		4.880	5.297	0,16
First Abu Dhabi Bank PJSC				
4,774 % fällig am 06.06.2028		9.100	9.026	0,27
Kuwait Projects Co. SPC Ltd.				
4,500 % fällig am 23.02.2027		4.000	3.411	0,10
MDGH GMTN RSC Ltd.				
3,950 % fällig am 21.05.2050		1.600	1.334	0,04
5,084 % fällig am 22.05.2053		2.700	2.690	0,08
			47.629	1,40
KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG				
NMC OpCo Ltd.				
11,255 % fällig am 25.03.2027	AED	36.775	10.112	0,30
STAATSEMISSIONEN				
Emirate of Abu Dhabi Government International Bond				
3,125 % fällig am 30.09.2049	$	900	661	0,02
3,875 % fällig am 16.04.2050		14.500	12.226	0,36
Emirate of Dubai Government International Bond				
3,900 % fällig am 09.09.2050		1.700	1.234	0,04
Finanzministerium der Regierung von Schardscha				
4,000 % fällig am 28.07.2050		9.000	5.784	0,17
			19.905	0,59
Summe Vereinigte Arabische Emirate			77.646	2,29

BESCHREIBUNG		PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
GROSSBRITANNIEN				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Antofagasta PLC				
2,375 % fällig am 14.10.2030	$	2.200	$ 1.795	0,05
Barclays PLC				
5,304 % fällig am 09.08.2026		8.400	8.197	0,24
HSBC Holdings PLC				
3,973 % fällig am 22.05.2030		400	360	0,01
Lloyds Banking Group PLC				
4,716 % fällig am 11.08.2026		3.700	3.597	0,11
NatWest Group PLC				
2,875 % fällig am 19.09.2026	£	400	461	0,01
4,269 % fällig am 22.03.2025	$	200	197	0,01
4,800 % fällig am 05.04.2026		1.100	1.068	0,03
5,076 % fällig am 27.01.2030		200	191	0,01
Santander UK Group Holdings PLC				
6,833 % fällig am 21.11.2026		900	903	0,03
Ukraine Railways Via Rail Capital Markets PLC				
8,250 % fällig am 09.07.2026 ^		16.100	6.198	0,18
Ukreximbank Via Biz Finance PLC				
9,750 % fällig am 22.01.2025		1.458	1.275	0,04
			24.242	0,72
NON-AGENCY-MBS				
Canada Square Funding PLC				
5,316 % fällig am 17.01.2059	£	2.749	3.475	0,10
Formentera Issuer PLC				
5,357 % fällig am 28.07.2047		154	194	0,01
Polaris PLC				
6,154 % fällig am 27.05.2057		322	409	0,01
Rochester Financing PLC				
5,602 % fällig am 18.12.2044		2.951	3.707	0,11
Stratton Mortgage Funding PLC				
5,765 % fällig am 12.03.2052		691	876	0,02
Towd Point Mortgage Funding PLC				
5,841 % fällig am 20.07.2045		705	897	0,03
6,097 % fällig am 20.05.2045		1.138	1.442	0,04
6,546 % fällig am 20.02.2054		2.386	3.034	0,09
Tower Bridge Funding PLC				
5,629 % fällig am 20.12.2063		1.910	2.417	0,07
Warwick Finance Residential Mortgages PLC				
0,000 % fällig am 21.12.2049 (d)		0	596	0,02
5,865 % fällig am 21.12.2049		3.311	4.190	0,12
6,564 % fällig am 21.12.2049		735	926	0,03
7,064 % fällig am 21.12.2049		367	460	0,01
7,564 % fällig am 21.12.2049		210	262	0,01
8,064 % fällig am 21.12.2049		210	258	0,01
			23.143	0,68
Summe Großbritannien			47.385	1,40
USA				
FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE				
Aames Mortgage Investment Trust				
5,630 % fällig am 25.04.2036	$	2.964	2.636	0,08
Argent Securities Trust				
5,450 % fällig am 25.07.2036		942	803	0,02
Argent Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates				
5,630 % fällig am 25.05.2035		446	402	0,01
Countrywide Asset-Backed Certificates Trust				
5,630 % fällig am 25.02.2037		1.539	1.481	0,04
6,275 % fällig am 25.11.2035		3.657	3.556	0,10
GSAA Home Equity Trust				
5,590 % fällig am 25.05.2047		723	456	0,01
5,630 % fällig am 25.11.2036		259	92	0,00
6,502 % fällig am 25.11.2036		868	346	0,01
Home Equity Asset Trust				
6,500 % fällig am 25.02.2033		218	203	0,01
Humboldt Americas LLC				
0,000 % fällig am 31.07.2022	COP	20.000.000	4.722	0,14
JPMorgan Mortgage Acquisition Trust				
5,420 % fällig am 25.08.2036	$	100	89	0,00
Lehman XS Trust				
5,058 % fällig am 25.01.2036 ^		2.078	1.930	0,06
MASTR Asset-Backed Securities Trust				
5,590 % fällig am 25.11.2036	$	1.081	$ 644	0,02
Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust				
5,350 % fällig am 25.02.2037		1.420	686	0,02
5,915 % fällig am 25.01.2035		185	172	0,01
Morgan Stanley Mortgage Loan Trust				
5,610 % fällig am 25.02.2037		177	42	0,00
Option One Mortgage Loan Trust				
5,370 % fällig am 25.04.2037		730	519	0,02
5,370 % fällig am 25.05.2037		563	332	0,01
Park Place Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates				
5,930 % fällig am 25.09.2035		3.900	3.279	0,10
Renaissance Home Equity Loan Trust				
5,797 % fällig am 25.08.2036		780	318	0,01
Saxon Asset Securities Trust				
5,460 % fällig am 25.09.2037		261	246	0,01
Soundview Home Loan Trust				
5,320 % fällig am 25.08.2037		581	492	0,01
5,650 % fällig am 25.11.2036		71	66	0,00
5,675 % fällig am 25.03.2036		571	565	0,02
6,050 % fällig am 25.10.2037		1.310	1.034	0,03
			25.111	0,74
		AKTIEN		
STAMMAKTIEN				
ENERGIE				
Constellation Oil Services Holding S.A. 'B' (c)(h)		4.243.669	460	0,01
		PARI (000S)		
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
DAE Funding LLC				
2,625 % fällig am 20.03.2025	$	3.500	3.295	0,10
Pricoa Global Funding				
4,200 % fällig am 28.08.2025		450	437	0,01
Rio Oil Finance Trust				
8,200 % fällig am 06.04.2028		8.794	8.849	0,26
9,250 % fällig am 06.07.2024		4.464	4.507	0,13
9,750 % fällig am 06.01.2027		6.439	6.648	0,20
Rutas 2 and 7 Finance Ltd.				
0,000 % fällig am 30.09.2036 (d)		5.040	3.305	0,10
			27.041	0,80
KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG				
Ecopetrol S.A.				
TBD % fällig am 17.08.2024		15.200	14.965	0,44
NON-AGENCY-MBS				
Banc of America Merrill Lynch Commercial Mortgage, Inc.				
4,407 % fällig am 15.11.2061		3.700	3.517	0,10
Banc of America Mortgage Trust				
3,896 % fällig am 25.02.2036 ^		4	4	0,00
BCAP LLC Trust				
3,676 % fällig am 26.05.2037		3.503	3.158	0,09
Bear Stearns Adjustable Rate Mortgage Trust				
3,887 % fällig am 25.05.2047 ^		84	75	0,00
4,033 % fällig am 25.01.2035		4	4	0,00
Bear Stearns ALT-A Trust				
4,195 % fällig am 25.05.2035		61	57	0,00
Benchmark Mortgage Trust				
3,666 % fällig am 15.01.2051		1.700	1.556	0,05
4,261 % fällig am 10.10.2051		4.800	4.435	0,13
Citigroup Mortgage Loan Trust				
3,974 % fällig am 25.09.2037 ^		169	149	0,00
CitiMortgage Alternative Loan Trust				
5,800 % fällig am 25.10.2036		1.016	848	0,03
Countrywide Alternative Loan Trust				
5,500 % fällig am 25.05.2036 ^		1.025	420	0,01
5,797 % fällig am 20.12.2035		591	552	0,02
Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust				
3,573 % fällig am 20.05.2036 ^		85	78	0,00
3,884 % fällig am 25.11.2037		434	397	0,01
Countrywide Home Loan Reperforming REMIC Trust				
5,590 % fällig am 25.11.2034		197	186	0,01
Deutsche ALT-A Securities Mortgage Loan Trust				
5,480 % fällig am 25.08.2037 ^	$	700	$ 593	0,02
GSMPS Mortgage Loan Trust				
5,500 % fällig am 25.01.2036		144	118	0,00
GSR Mortgage Loan Trust				
3,935 % fällig am 25.01.2036 ^		25	24	0,00
HarborView Mortgage Loan Trust				
5,976 % fällig am 19.10.2035		99	55	0,00
HomeBanc Mortgage Trust				
5,670 % fällig am 25.01.2036		224	213	0,01
Impac CMB Trust				
5,790 % fällig am 25.03.2035		76	70	0,00
IndyMac Mortgage Loan Trust				
3,062 % fällig am 25.11.2037		204	167	0,01
5,510 % fällig am 25.02.2037		1.000	964	0,03
5,510 % fällig am 25.02.2037 ^		314	280	0,01
5,790 % fällig am 25.07.2045		336	265	0,01
JPMorgan Resecuritization Trust				
2,500 % fällig am 25.03.2056		224	211	0,01
Lehman XS Trust				
5,530 % fällig am 25.09.2046		1.974	1.689	0,05
Residential Accredit Loans, Inc. Trust				
6,000 % fällig am 25.08.2036 ^		346	282	0,01
Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust				
4,491 % fällig am 25.09.2037		21	19	0,00
Structured Asset Mortgage Investments Trust				
5,300 % fällig am 25.02.2037		722	651	0,02
SunTrust Adjustable Rate Mortgage Loan Trust				
3,732 % fällig am 25.10.2037 ^		551	486	0,01
TBW Mortgage-Backed Trust				
6,540 % fällig am 25.01.2037 ^		1.270	309	0,01
WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust				
3,772 % fällig am 25.02.2037 ^		158	142	0,00
3,883 % fällig am 25.03.2036		912	831	0,03
5,046 % fällig am 25.01.2046		85	74	0,00
5,520 % fällig am 25.05.2034		142	126	0,00
Wells Fargo Mortgage-Backed Securities Trust				
4,478 % fällig am 25.10.2036		323	301	0,01
			23.306	0,69
US-REGIERUNGSBEHÖRDEN				
Fannie Mae				
4,323 % fällig am 01.03.2036		14	14	0,00
Uniform Mortgage-Backed Security				
5,500 % fällig am 01.02.2038		1	1	0,00
Uniform Mortgage-Backed Security, TBA				
2,500 % fällig am 01.08.2053		12.450	10.575	0,31
3,500 % fällig am 01.08.2053		14.100	12.863	0,38
			23.453	0,69
US-SCHATZOBLIGATIONEN				
U.S. Treasury Bonds				
1,750 % fällig am 15.08.2041		12.300	8.650	0,26
2,375 % fällig am 15.02.2042		25.000	19.476	0,57
3,250 % fällig am 15.05.2042		113.500	101.339	2,99
3,375 % fällig am 15.08.2042		17.800	16.165	0,48
U.S. Treasury Notes				
2,375 % fällig am 15.05.2029		7.900	7.205	0,21
2,625 % fällig am 31.07.2029		30.000	27.719	0,82
3,125 % fällig am 31.08.2029		52.000	49.400	1,46
4,000 % fällig am 28.02.2030 (i)		33.100	33.082	0,97
			263.036	7,76
		AKTIEN		
OPTIONSSCHEINE				
Constellation Oil Services Holding S.A. 'D' - Exp. 10.06.2071 (h)		5	0	0,00
Summe USA			377.372	11,13
		PARI (000S)		
USBEKISTAN				
STAATSEMISSIONEN				
Uzbekistan Government International Bond				
3,700 % fällig am 25.11.2030	$	200	162	0,00
3,900 % fällig am 19.10.2031		8.400	6.773	0,20
Summe Usbekistan			6.935	0,20

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
VENEZUELA			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Petroleos de Venezuela S.A.			
5,375 % fällig am 12.04.2027 ^	$ 73.690	$ 2.601	0,08
5,500 % fällig am 12.04.2037 ^	19.365	751	0,02
6,000 % fällig am 16.05.2024 ^	3.500	136	0,00
		3.488	0,10
STAATSEMISSIONEN			
Venezuela Government International Bond			
7,000 % fällig am 31.03.2038 ^	19.650	1.719	0,05
7,650 % fällig am 21.04.2025 ^	6.624	579	0,02
7,750 % fällig am 13.10.2019 ^	20.130	1.208	0,03
8,250 % fällig am 13.10.2024 ^	12.483	1.155	0,03
9,000 % fällig am 07.05.2023 ^	9.878	889	0,03
9,250 % fällig am 15.09.2027 ^	13.410	1.207	0,04
9,250 % fällig am 07.05.2028 ^	11.868	1.068	0,03
11,950 % fällig am 05.08.2031 ^	2.930	271	0,01
		8.096	0,24
Summe Venezuela		11.584	0,34
VIETNAM			
STAATSEMISSIONEN			
Vietnam Government International Bond			
4,800 % fällig am 19.11.2024	500	492	0,01

BESCHREIBUNG	PARI (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
JUNGFERNINSELN (BRITISCH)			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
CLP Power Hong Kong Financing Ltd.			
2,125 % fällig am 30.06.2030	$ 5.300	$ 4.403	0,13
SAMBIA			
STAATSEMISSIONEN			
Zambia Government International Bond			
5,375 % fällig am 20.09.2022 ^	4.050	2.136	0,06
8,500 % fällig am 14.04.2024 ^	2.100	1.226	0,04
Summe Sambia		3.362	0,10
KURZFRISTIGE INSTRUMENTE			
COMMERCIAL PAPER			
Amcor PLC			
5,450 % fällig am 07.07.2023	3.300	3.297	0,10
Summe kurzfristige Instrumente		3.297	0,10
Summe Übertragbare Wertpapiere		**$ 3.348.247**	**98,78**

BESCHREIBUNG	AKTIEN	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
INVESTMENTFONDS			
ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN			
PIMCO Funds: Global Investors Series plc - PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund (f)	2.357.350	$ 25.082	0,74
PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (f)	19.436	194	0,01
PIMCO Specialty Funds Ireland p.l.c. - PIMCO China Bond Fund (f)	384.360	5.009	0,14
Summe Investmentfonds		**$ 30.285**	**0,89**

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

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

FUTURES

Beschreibung	Art	Ablauf-monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Euro-Bobl September Futures	Long	09.2023	464	$ (767)	(0,02)
Euro-Bund 10-Year Bond September Futures	Short	09.2023	489	642	0,02
Euro-Buxl 30-Year Bond September Futures	Short	09.2023	68	(129)	0,00
U.S. Treasury 2-Year Note September Futures	Long	09.2023	1.190	(2.206)	(0,06)
U.S. Treasury 5-Year Note September Futures	Short	09.2023	3.031	5.924	0,17
U.S. Treasury 10-Year Note September Futures	Long	09.2023	4.634	(9.046)	(0,27)
U.S. Treasury 10-Year Ultra September Futures	Short	09.2023	116	133	0,00
U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond September Futures	Long	09.2023	87	143	0,00
				$ (5.306)	(0,16)
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate				**$ (5.306)**	**(0,16)**

ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)

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

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMMISSIONEN - SCHUTZVERKAUF[1]

Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag[3]	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
AT&T, Inc.	1,000 %	20.06.2024	$ 500	$ 3	0,00
General Electric Co.	1,000	20.12.2023	1.500	4	0,00
				$ 7	0,00

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES - SCHUTZKAUF[2]

Index/Tranchen	Zu bezahlender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag[3]	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
CDX.EM-38 5-Year Index	(1,000) %	20.12.2027	$ 22.800	$ (333)	(0,01)

ZINSSWAPS

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Zahlung	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	5,585 %	28.06.2026	£ 19.170	$ (38)	0,00
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	0,000	15.09.2023	$ 5.700	80	0,00
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,000	21.09.2024	90.600	3.219	0,11
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,000	15.06.2029	11.100	(1.112)	(0,03)

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits-datum		Nenn-betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Zahlung[4]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,500 %	21.06.2027	$	13.700	$ (2.108)	(0,06)
Zahlung[4]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,500	15.12.2028		400	(50)	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,750	15.06.2024		93.700	(388)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,750	15.12.2031		5.700	(975)	(0,03)
Erhalt[4]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,250	21.12.2046		1.200	517	0,02
Erhalt[4]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,500	15.06.2046		600	268	0,01
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,415	04.01.2027	BRL	104.000	475	0,01
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,453	04.01.2027		57.600	273	0,01
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,620	04.01.2027		15.800	90	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,828	02.01.2025		87.000	58	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	12,220	02.01.2025		210.200	154	0,00
Erhalt	1-Year BRL-CDI	13,015	04.01.2027		102.700	(1.342)	(0,04)
Erhalt	1-Year BRL-CDI	13,190	02.01.2025		36.500	(196)	(0,01)
Erhalt	1-Year BRL-CDI	13,215	02.01.2025		38.600	(210)	(0,01)
Erhalt	1-Year BRL-CDI	13,400	02.01.2025		86.600	(524)	(0,02)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	13,400	02.01.2025		124.500	757	0,02
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	0,000	15.09.2023	$	5.700	(81)	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,500	15.09.2023		400	(4)	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,500	21.09.2023		13.700	(142)	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,250	21.09.2023		1.200	10	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,500	15.09.2023		600	5	0,00
Erhalt	3-Month ZAR-JIBAR	5,950	30.11.2024	ZAR	560.000	1.093	0,03
Zahlung	6-Month CZK-PRIBOR	4,611	06.06.2028	CZK	866.200	(218)	(0,01)
Erhalt[4]	6-Month EUR-EURIBOR	3,000	20.09.2033	€	7.400	(64)	0,00
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR	5,455	10.01.2028	PLN	24.000	(49)	0,00
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR	5,490	10.01.2028		22.800	(55)	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	8,585	18.05.2028	MXN	48.600	(24)	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	8,740	07.03.2028		242.000	164	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	8,760	19.05.2028		2.100	(2)	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	8,900	21.05.2027		166.600	(93)	0,00
						$ (512)	(0,01)
Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate						**$ (838)**	**(0,02)**

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

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

(3) Der maximal mögliche Betrag, den der Fonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

(4) Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft.

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

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

VERKAUFSOPTIONEN

ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag[1]	Aufgeld	Markt-wert	% des Nettovermögens
BOA	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,380 %	31.07.2023	5.900	$ (23)	$ (28)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,780	31.07.2023	5.900	(23)	(17)	0,00
BRC	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,260	26.07.2023	3.400	(11)	(7)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,660	26.07.2023	3.400	(11)	(16)	0,00
	Call - OTC 7-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,350	27.07.2023	2.700	(6)	(5)	0,00
	Put - OTC 7-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,850	27.07.2023	2.700	(6)	(10)	0,00
GLM	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,260	26.07.2023	3.300	(11)	(7)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,660	26.07.2023	3.300	(11)	(16)	0,00
	Call - OTC 7-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,350	27.07.2023	2.700	(6)	(5)	0,00
	Put - OTC 7-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,850	27.07.2023	2.700	(6)	(10)	0,00
MYC	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,270	24.07.2023	5.100	(17)	(9)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,670	24.07.2023	5.100	(17)	(21)	0,00
							$ (148)	$ (151)	0,00

(1) Der Nennbetrag stellt die Anzahl der Kontrakte dar.

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMMISSIONEN - SCHUTZKAUF[1]

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu bezahlender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag[3]	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Marktwert	% des Nettovermögens
BOA	Oman Government International Bond	(1,000) %	20.12.2027	$ 2.300	$ 76	$ (44)	$ 32	0,00
	Turkey Government International Bond	(1,000)	20.12.2026	8.500	1.413	(513)	900	0,03
BPS	Oman Government International Bond	(1,000)	20.12.2027	1.100	36	(21)	15	0,00
BRC	Oman Government International Bond	(1,000)	20.12.2027	2.400	64	(31)	33	0,00
CBK	Turkey Government International Bond	(1,000)	20.12.2026	3.900	651	(238)	413	0,01
GST	South Korea Government International Bond	(1,000)	20.06.2028	17.000	(449)	(67)	(516	(0,01)
HUS	Dubai Government International Bond	(1,000)	20.12.2024	3.600	(12)	(26)	(38	0,00
JPM	Dubai Government International Bond	(1,000)	20.12.2024	1.500	(2)	(14)	(16	0,00
	South Africa Government International Bond	(1,000)	20.06.2026	27.250	1.274	(601)	673	0,02
	Turkey Government International Bond	(1,000)	20.12.2025	6.300	608	(141)	467	0,01
MYC	Turkey Government International Bond	(1,000)	20.12.2026	800	135	(50)	85	0,00
					$ 3.794	$ (1.746)	$ 2.048	0,06

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMMISSIONEN - SCHUTZVERKAUF[2]

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag[3]	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Marktwert	% des Nettovermögens
BOA	Chile Government International Bond	1,000 %	20.06.2024	$ 8.100	$ 26	$ 45	$ 71	0,00
	Chile Government International Bond	1,000	20.12.2026	700	4	8	12	0,00
	Chile Government International Bond	1,000	20.12.2027	5.000	(18)	93	75	0,00
	Mexico Government International Bond	1,000	20.06.2024	13.200	4	102	106	0,00
	Peru Government International Bond	1,000	20.06.2026	2.900	26	25	51	0,00
	Peru Government International Bond	1,000	20.12.2031	2.000	(84)	45	(39)	0,00
	South Africa Government International Bond	1,000	20.12.2025	9.600	(526)	363	(163)	0,00
BPS	Brazil Government International Bond	1,000	20.12.2027	2.500	(171)	116	(55)	0,00
	Chile Government International Bond	1,000	20.12.2023	1.100	3	2	5	0,00
	Chile Government International Bond	1,000	20.12.2024	5.400	6	60	66	0,00
	Chile Government International Bond	1,000	20.12.2026	6.800	39	82	121	0,00
	Chile Government International Bond	1,000	20.06.2027	10.000	(182)	358	176	0,01
	Colombia Government International Bond	1,000	20.12.2023	5.800	(3)	21	18	0,00
	Mexico Government International Bond	1,000	20.12.2023	900	1	3	4	0,00
	Mexico Government International Bond	1,000	20.06.2024	3.900	(6)	37	31	0,00
	Mexico Government International Bond	1,000	20.12.2024	2.000	(4)	25	21	0,00
	Mexico Government International Bond	1,000	20.12.2026	4.900	6	49	55	0,00
	Peru Government International Bond	1,000	20.06.2026	32.100	116	446	562	0,02
	Poland Government International Bond	1,000	20.12.2023	900	3	1	4	0,00
	Romania Government International Bond	1,000	20.12.2023	1.800	(8)	13	5	0,00
	Serbia Government International Bond	1,000	20.12.2027	1.800	(159)	78	(81)	0,00
	South Africa Government International Bond	1,000	20.12.2023	2.900	(5)	9	4	0,00
BRC	Argentina Government International Bond	5,000	20.12.2023	6.800	(985)	484	(501)	(0,01)
	Chile Government International Bond	1,000	20.06.2024	4.500	12	28	40	0,00
	Hungary Government International Bond	1,000	20.12.2023	5.300	(38)	53	15	0,00
	Philippines Government International Bond	1,000	20.06.2028	13.500	62	53	115	0,00
	Poland Government International Bond	1,000	20.06.2028	3.200	24	12	36	0,00
	Romania Government International Bond	1,000	20.12.2023	1.000	(8)	11	3	0,00
	Saudi Arabia Government International Bond	1,000	20.12.2024	15.687	(277)	442	165	0,01
CBK	Brazil Government International Bond	1,000	20.12.2026	5.000	(237)	221	(16)	0,00
	Chile Government International Bond	1,000	20.12.2024	3.300	8	33	41	0,00
	China Government International Bond	1,000	20.06.2028	4.500	58	22	80	0,00
	Colombia Government International Bond	1,000	20.12.2023	5.800	(2)	20	18	0,00
	Colombia Government International Bond	1,000	20.06.2024	500	(5)	7	2	0,00
	Indonesia Government International Bond	1,000	20.06.2028	68.000	251	193	444	0,01
	Mexico Government International Bond	1,000	20.12.2026	6.000	11	56	67	0,00
	Panama Government International Bond	1,000	20.06.2024	3.400	6	18	24	0,00
	Panama Government International Bond	1,000	20.12.2024	5.900	0	54	54	0,00
	Peru Government International Bond	1,000	20.06.2026	2.200	19	20	39	0,00
	Saudi Arabia Government International Bond	1,000	20.06.2024	50.000	429	(51)	378	0,01
	Saudi Arabia Government International Bond	1,000	20.12.2024	1.200	(41)	54	13	0,00
DUB	Eskom Holdings SOC Ltd.	4,650	30.06.2029	16.000	0	497	497	0,02
	South Africa Government International Bond	1,000	20.06.2024	10.000	(131)	132	1	0,00
GLM	Romania Government International Bond	1,000	20.12.2023	800	(3)	5	2	0,00
GST	Brazil Government International Bond	1,000	20.06.2026	600	(32)	35	3	0,00
	Chile Government International Bond	1,000	20.12.2026	3.600	33	31	64	0,00
	Chile Government International Bond	1,000	20.06.2028	9.900	19	105	124	0,00
	Colombia Government International Bond	1,000	20.12.2023	2.700	(40)	49	9	0,00
	Mexico Government International Bond	1,000	20.12.2023	1.000	1	3	4	0,00
	Mexico Government International Bond	1,000	20.12.2024	100	(1)	2	1	0,00
	Mexico Government International Bond	1,000	20.06.2028	1.200	(20)	19	(1)	0,00
	Peru Government International Bond	1,000	20.06.2026	29.100	118	392	510	0,02
	Poland Government International Bond	1,000	20.12.2023	2.100	7	2	9	0,00
	Poland Government International Bond	1,000	20.06.2028	4.200	38	9	47	0,00
	Saudi Arabia Government International Bond	1,000	20.06.2024	3.000	29	(6)	23	0,00
	Saudi Arabia Government International Bond	1,000	20.12.2024	3.413	36	0	36	0,00
HUS	Mexico Government International Bond	1,000	20.06.2024	100	(1)	2	1	0,00
	Saudi Arabia Government International Bond	1,000	20.06.2024	9.700	103	(30)	73	0,00
JPM	Argentina Government International Bond	5,000	20.12.2023	4.700	(703)	356	(347)	(0,01)
	Banco do Brasil S.A.	1,000	20.12.2024	9.800	(220)	141	(79)	0,00
	Chile Government International Bond	1,000	20.12.2026	7.700	41	97	138	0,01
	Chile Government International Bond	1,000	20.06.2027	10.000	(178)	354	176	0,01

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag[3]	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Markt-wert	% des Nettovermögens
	Nigeria Government International Bond	5,000 %	20.06.2024	$ 10.000	$ 38	$ (66)	$ (28)	0,00
	Peru Government International Bond	1,000	20.06.2026	1.500	13	13	26	0,00
	Poland Government International Bond	1,000	20.06.2028	1.300	(3)	18	15	0,00
	Saudi Arabia Government International Bond	1,000	20.06.2024	11.100	140	(56)	84	0,00
	South Africa Government International Bond	1,000	20.12.2023	10.600	(171)	186	15	0,00
MYC	Brazil Government International Bond	1,000	20.06.2027	9.100	(564)	468	(96)	0,00
	Colombia Government International Bond	1,000	20.12.2023	5.100	(1)	17	16	0,00
	Mexico Government International Bond	1,000	20.06.2024	1.500	(1)	13	12	0,00
	Mexico Government International Bond	1,000	20.12.2024	4.100	(15)	58	43	0,00
	Mexico Government International Bond	1,000	20.06.2027	200	(1)	3	2	0,00
	Mexico Government International Bond	1,000	20.06.2028	2.700	(54)	51	(3)	0,00
	Peru Government International Bond	1,000	20.06.2026	37.300	105	548	653	0,02
	Peru Government International Bond	1,000	20.12.2026	3.000	(10)	61	51	0,00
	Saudi Arabia Government International Bond	1,000	20.06.2024	18.000	98	38	136	0,01
MYI	Peru Government International Bond	1,000	20.06.2026	2.700	23	24	47	0,00
					$ (2.952)	$ 7.282	$ 4.330	0,13

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

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

(3) Der maximal mögliche Betrag, den der Fonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2023	€ 476	$ 520	$ 1	$ 0	$ 1	0,00
	07.2023	¥ 900	6	0	0	0	0,00
	07.2023	$ 3.298	£ 2.608	17	0	17	0,00
	09.2023	NGN 211.518	$ 365	97	0	97	0,00
	09.2023	$ 36	NGN 27.936	0	(1)	(1)	0,00
BPS	07.2023	€ 253	$ 276	0	0	0	0,00
	07.2023	ILS 61.760	19.366	2.724	0	2.724	0,08
	07.2023	$ 53	BRL 256	0	0	0	0,00
	07.2023	248.363	€ 226.681	0	(1.054)	(1.054)	(0,03)
	07.2023	52.281	ILS 174.905	0	(5.150)	(5.150)	(0,15)
	07.2023	15.826	¥ 2.199.787	0	(606)	(606)	(0,02)
	07.2023	26	MYR 120	0	0	0	0,00
	08.2023	BRL 256	$ 53	0	0	0	0,00
	08.2023	CNH 27.980	4.049	190	0	190	0,01
	08.2023	COP 20.000.000	4.360	0	(354)	(354)	(0,01)
	08.2023	€ 223.228	244.935	1.059	0	1.059	0,03
	08.2023	MYR 108.777	23.416	40	0	40	0,00
	08.2023	$ 11	CNY 75	0	(1)	(1)	0,00
	08.2023	56.943	ILS 190.199	0	(5.653)	(5.653)	(0,17)
	08.2023	ZAR 255.815	$ 13.746	260	0	260	0,01
	09.2023	$ 4.336	INR 356.455	0	(3)	(3)	0,00
	12.2023	NGN 55.080	$ 68	1	0	1	0,00
	12.2023	$ 167	MXN 2.981	1	0	1	0,00
BRC	07.2023	21	MYR 98	0	0	0	0,00
	08.2023	COP 43.628.519	$ 10.241	0	(78)	(78)	0,00
	08.2023	ZAR 514.494	27.404	428	(145)	283	0,01
	09.2023	ILS 409	114	4	0	4	0,00
	09.2023	ZAR 347.160	19.656	1.406	0	1.406	0,04
	10.2023	MXN 280.418	14.966	0	(1.069)	(1.069)	(0,03)
CBK	07.2023	CZK 11.852	540	0	(4)	(4)	0,00
	07.2023	€ 17.656	19.026	0	(237)	(237)	(0,01)
	07.2023	ILS 113.145	35.324	4.835	0	4.835	0,14
	07.2023	$ 2.816	€ 2.624	47	0	47	0,00
	07.2023	160	MXN 2.891	8	0	8	0,00
	08.2023	CNH 29	$ 4	0	0	0	0,00
	08.2023	COP 28.384.920	6.713	1	(2)	(1)	0,00
	08.2023	ILS 190.199	58.940	7.650	0	7.650	0,22
	09.2023	COP 6.036.493	1.429	13	0	13	0,00
	10.2023	$ 431	NGN 257.586	0	(112)	(112)	0,00
	11.2023	ILS 147.240	$ 44.097	4.158	0	4.158	0,12
	11.2023	$ 2.209	EGP 71.296	0	(152)	(152)	(0,01)
DUB	10.2023	ZAR 123.036	$ 6.756	311	0	311	0,01
	11.2023	EGP 98.621	3.471	627	0	627	0,02
	01.2024	NGN 135.300	220	58	0	58	0,00
GLM	07.2023	BRL 97.666	19.868	0	(378)	(378)	(0,01)
	07.2023	DOP 802.203	13.855	0	(501)	(501)	(0,02)
	07.2023	ILS 23.207	6.893	635	0	635	0,02

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung		Zu erhaltende Währung		Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
	07.2023	$	18.219	BRL	97.409	$ 1.974	$ 0	$ 1.974	0,06
	08.2023	DOP	458.517	$	8.139	32	(100)	(68)	0,00
	09.2023	$	16.763	BRL	81.837	13	0	13	0,00
	10.2023	DOP	279.054	$	4.978	32	0	32	0,00
	10.2023	NGN	502.834		842	219	0	219	0,01
	11.2023	DOP	304.391		5.474	118	0	118	0,00
	11.2023	EGP	32.430		1.150	215	0	215	0,01
	11.2023	$	2.849	EGP	86.895	0	(342)	(342)	(0,01)
	12.2023	DOP	175.615	$	3.154	74	0	74	0,00
JPM	07.2023	¥	748.822		5.236	55	0	55	0,00
	07.2023	MXN	655		38	0	0	0	0,00
	07.2023	$	283	NGN	154.832	0	(82)	(82)	0,00
	08.2023	BRL	87.356	$	17.044	0	(977)	(977)	(0,03)
	08.2023	CNH	22.460		3.250	153	0	153	0,00
	08.2023	COP	16.649.644		3.927	0	(27)	(27)	0,00
	08.2023	MXN	313.246		18.080	0	(37)	(37)	0,00
	08.2023	$	12	CNY	79	0	(1)	(1)	0,00
	08.2023		301	HUF	105.169	3	0	3	0,00
	08.2023		5.236	¥	745.640	0	(55)	(55)	0,00
	09.2023	COP	14.897.873	$	3.488	0	(7)	(7)	0,00
	09.2023	ILS	393		111	4	0	4	0,00
	09.2023	PEN	27.390		7.439	0	(72)	(72)	0,00
	09.2023	$	309	NGN	183.604	0	(77)	(77)	0,00
	10.2023		395		244.639	0	(91)	(91)	0,00
	12.2023	NGN	248.400	$	400	97	0	97	0,00
	12.2023	$	480	NGN	303.360	0	(110)	(110)	0,00
	01.2024		81		66.987	0	(1)	(1)	0,00
MBC	07.2023	€	4.485	$	4.805	0	(88)	(88)	0,00
	07.2023	£	20.035		24.801	0	(671)	(671)	(0,02)
	09.2023	$	12.152	INR	999.110	0	(7)	(7)	0,00
MYI	07.2023	AUD	2	$	1	0	0	0	0,00
	07.2023	£	3		4	0	0	0	0,00
	07.2023	$	162	€	148	0	0	0	0,00
	07.2023		322	£	255	2	0	2	0,00
	08.2023		2.692	ZAR	49.273	0	(94)	(94)	0,00
	09.2023	AED	37.686	$	10.260	0	0	0	0,00
	11.2023	EGP	28.556		1.012	188	0	188	0,01
	01.2024	NGN	322.875		525	139	0	139	0,00
RBC	08.2023	$	16.048	MXN	278.106	37	0	37	0,00
SCX	07.2023	NGN	189.245	$	359	114	0	114	0,00
	07.2023	$	291	€	266	0	0	0	0,00
	07.2023		26	MYR	122	0	0	0	0,00
	07.2023		45	NGN	34.560	0	0	0	0,00
	08.2023	CNH	10.645	$	1.547	79	0	79	0,00
	01.2024	$	557	NGN	457.854	0	(10)	(10)	0,00
SOG	07.2023	€	204.733	$	220.240	0	(3.125)	(3.125)	(0,09)
	07.2023	PLN	661		153	0	(9)	(9)	0,00
TOR	07.2023	$	22.145	£	17.427	11	0	11	0,00
	08.2023	£	17.427	$	22.149	0	(11)	(11)	0,00
	08.2023	$	190	HUF	66.613	2	0	2	0,00
UAG	07.2023	€	1.711	$	1.831	0	(36)	(36)	0,00
	07.2023	$	11	SGD	15	0	0	0	0,00
	07.2023		985	TRY	22.691	0	(121)	(121)	0,00
	09.2023	ILS	340	$	95	3	0	3	0,00
	09.2023	$	18	SGD	25	0	0	0	0,00
	09.2023	ZAR	46.533	$	2.654	208	0	208	0,01
	10.2023		39.650		2.142	65	0	65	0,00
						$ 28.408	$ (21.651)	$ 6.757	0,20

ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklasse M Retail AUD (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung		Zu erhaltende Währung		Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
AZD	07.2023	AUD	118	$	78	$ 0	$ 0	$ 0	0,00
	07.2023	$	265	AUD	399	2	(1)	1	0,00
	08.2023		78		118	0	0	0	0,00
BOA	07.2023		306		465	5	(2)	3	0,00
BPS	07.2023	AUD	617	$	408	0	(2)	(2)	0,00
	07.2023	$	61	AUD	90	0	(1)	(1)	0,00
	08.2023		400		603	2	0	2	0,00
CBK	07.2023		67		103	1	0	1	0,00
JPM	07.2023		101		154	2	0	2	0,00
RBC	07.2023		68		100	0	(2)	(2)	0,00
SCX	07.2023	AUD	208	$	138	0	0	0	0,00
	07.2023	$	81	AUD	123	2	0	2	0,00
	08.2023		138		208	0	0	0	0,00
SOG	07.2023		160		245	3	0	3	0,00
TOR	07.2023	AUD	363	$	240	0	(2)	(2)	0,00

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
	07.2023	$ 170	AUD 260	$ 3	$ 0	$ 3	0,00
	08.2023	240	363	2	0	2	0,00
UAG	07.2023	AUD 699	$ 464	1	(2)	(1)	0,00
	07.2023	$ 82	AUD 126	1	0	1	0,00
	08.2023	464	699	2	(1)	1	0,00
				$ 26	$ (13)	$ 13	0,00

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklasse Institutional CHF (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BPS	07.2023	CHF 23.912	$ 26.737	$ 9	$ 0	$ 9	0,00
	07.2023	$ 34.819	CHF 31.500	391	0	391	0,01
	08.2023	26.737	23.844	0	(9)	(9)	0,00
CLY	07.2023	CHF 12.638	$ 14.070	0	(57)	(57)	0,00
	08.2023	$ 14.070	CHF 12.602	57	0	57	0,00
MBC	07.2023	608	546	2	0	2	0,00
MYI	07.2023	CHF 658	$ 726	0	(9)	(9)	0,00
	07.2023	$ 1	CHF 1	0	0	0	0,00
SCX	07.2023	25.034	22.494	109	0	109	0,01
UAG	07.2023	CHF 24.696	$ 27.549	0	(54)	(54)	0,00
	07.2023	$ 22.576	CHF 20.286	98	0	98	0,00
	08.2023	27.549	24.625	54	0	54	0,00
				$ 720	$ (129)	$ 591	0,02

Zum 30. Juni 2023 standen für die Institutional EUR (Hedged) thesaurierend, Institutional EUR (Hedged) ausschüttend, Investor EUR (Hedged) thesaurierend und Class E EUR (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2023	$ 440.629	€ 409.994	$ 6.675	$ (1)	$ 6.674	0,20
BPS	07.2023	€ 414.754	$ 454.446	1.949	0	1.949	0,06
	07.2023	$ 439.456	€ 408.793	6.537	0	6.537	0,19
	08.2023	455.044	414.717	0	(1.968)	(1.968)	(0,06)
CBK	07.2023	€ 408.820	$ 444.295	0	(1.728)	(1.728)	(0,05)
	07.2023	$ 19.107	€ 17.470	4	(51)	(47)	0,00
	08.2023	430.473	395.389	1.487	0	1.487	0,04
JPM	07.2023	€ 414.649	$ 452.755	373	0	373	0,01
	07.2023	$ 22.319	€ 20.875	456	0	456	0,01
	08.2023	453.389	414.649	0	(387)	(387)	(0,01)
MBC	07.2023	€ 28.027	$ 30.074	0	(503)	(503)	(0,01)
	07.2023	$ 407	€ 371	0	(2)	(2)	0,00
SOG	07.2023	439.704	408.746	6.238	0	6.238	0,18
				$ 23.719	$ (4.640)	$ 19.079	0,56

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklassen Institutional GBP (Hedged) thesaurierend und Institutional GBP (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2023	£ 168	$ 212	$ 0	$ (1)	$ (1)	0,00
	07.2023	$ 114	£ 90	0	0	0	0,00
BPS	07.2023	£ 358	$ 444	0	(11)	(11)	0,00
	07.2023	$ 19.068	£ 15.417	531	0	531	0,02
BRC	07.2023	£ 205	$ 259	0	(2)	(2)	0,00
CBK	07.2023	283	360	0	0	0	0,00
	07.2023	$ 31	£ 25	0	0	0	0,00
JPM	07.2023	£ 15.265	$ 19.301	0	(106)	(106)	0,00
	08.2023	$ 19.305	£ 15.265	106	0	106	0,00
MBC	07.2023	£ 510	$ 652	4	0	4	0,00
	07.2023	$ 19.395	£ 15.666	522	0	522	0,01
MYI	07.2023	£ 16	$ 19	0	0	0	0,00
	07.2023	$ 19.115	£ 15.380	438	0	438	0,01
TOR	07.2023	£ 15.303	$ 19.446	0	(10)	(10)	0,00
	08.2023	$ 19.450	£ 15.303	10	0	10	0,00
				$ 1.611	$ (130)	$ 1.481	0,04

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklassen Institutional SGD (Hedged) thesaurierend und Class E SGD (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BRC	07.2023	$ 8.661	SGD 11.719	$ 0	$ (1)	$ (1)	0,00
GLM	07.2023	SGD 613	$ 457	4	0	4	0,00
	07.2023	$ 217	SGD 294	0	0	0	0,00
JPM	07.2023	SGD 11.744	$ 8.678	1	0	1	0,00

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
	07.2023	$ 1.202	SGD 1.627	$ 0	$ 0	$ 0	0,00
	08.2023	8.678	11.732	0	(1)	(1)	0,00
MBC	07.2023	7.886	10.655	0	(13)	(13)	0,00
	08.2023	11	15	0	0	0	0,00
MYI	07.2023	SGD 11.385	$ 8.426	13	0	13	0,00
	08.2023	$ 8.426	SGD 11.374	0	(13)	(13)	0,00
UAG	07.2023	SGD 21	$ 16	0	0	0	0,00
	07.2023	$ 8.512	SGD 11.515	0	(4)	(4)	0,00
				$ 18	$ (32)	$ (14)	0,00
Summe Freiverkehrsfinanzderivate						**$ 34.134**	**1,01**

BESCHREIBUNG		PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
EINLAGENZERTIFIKATE				
Banco Davivienda S.A.				
13,501 % fällig am 13.12.2024	COP	15.106.000	$ 3.617	0,11
15,389 % fällig am 21.02.2024		4.622.500	1.123	0,03
BanColombia S.A.				
5,917 % fällig am 27.01.2024		21.517.000	4.960	0,15
13,320 % fällig am 08.06.2025		7.817.000	1.879	0,06
13,637 % fällig am 14.12.2024		20.654.000	4.975	0,15
16,137 % fällig am 01.09.2024		8.476.000	2.053	0,06
BBVA Colombia S.A.				
5,870 % fällig am 15.07.2024		17.362.000	3.906	0,11
14,540 % fällig am 13.01.2024		9.047.900	2.149	0,06
16,412 % fällig am 25.04.2024		334.000	78	0,00
Summe Einlagenzertifikate			**$ 24.740**	**0,73**
Summe Anlagen			**$ 3.431.262**	**101,23**
Sonstige Aktiva und Passiva			**$ (41.615)**	**(1,23)**
Nettovermögen			**$ 3.389.647**	**100,00**

ERLÄUTERUNGEN ZUR AUFSTELLUNG DES WERTPAPIERBESTANDS (Angaben in Tausend*):

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

^ Das Wertpapier ist in Verzug.

(a) Wertpapier per Emissionstermin.

(b) Wertpapier mit Sachwertausschüttung.

(c) Das Wertpapier hat in den letzten zwölf Monaten keine Erträge geliefert.

(d) Nullkuponwertpapier.

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

(f) Mit dem Fonds verbunden.

(g) Bedingt wandelbares Wertpapier.

(h) Eingeschränkte Wertpapiere (31. Dezember 2022: 0,89 %):

Emittentenbeschreibung	Kauf-datum	Kosten	Markt-wert	% des Nettovermögens
Constellation Oil Services Holding S.A. ‘B’	10.06.2022	$ 460	$ 460	0,01
Constellation Oil Services Holding S.A. ‘D’ - Exp. 10.06.2071	10.06.2022	0	0	0,00
Development Bank of Southern Africa 8,600 % fällig am 21.10.2024	07.10.2021	31.381	24.311	0,72
DrillCo Holding Lux S.A.	08.06.2023	7.281	6.989	0,21
		$ 39.122	$ 31.760	0,94

(i) Wertpapiere mit einem gesamten beizulegenden Zeitwert von 56.824 USD (31. Dezember 2022: 84.485 USD) und Barmittel in Höhe von 520 USD (31. Dezember 2022: 842 USD) wurden zum 30. Juni 2023 gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen als Sicherheit für Pensionsgeschäfte verpfändet.

Wertpapier mit einem gesamten beizulegenden Zeitwert von 22 USD (31. Dezember 2022: null USD) und Barmittel in Höhe von null USD (31. Dezember 2022: 3.002 USD) wurden zum 30. Juni 2023 gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen als Sicherheit für Pensionsgeschäfte geliefert.

Barmittel in Höhe von 19.480 USD (31. Dezember 2022: 36.243 USD) wurden zum 30. Juni 2023 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Barmittel in Höhe von 1.880 USD (31. Dezember 2022: 11.680 USD) wurden zum 30. Juni 2023 gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. als Sicherheit für Finanzderivate verpfändet.

Beizulegender Zeitwert[1]

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 30. Juni 2023 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie[2]	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	$ 1	$ 3.264.035	$ 84.211	$ 3.348.247
Investmentfonds	30.285	0	0	30.285
Finanzderivate[3]	(254)	27.747	497	27.990
Einlagen bei Kreditinstituten	0	8.310	16.430	24.740
Summen	**$ 30.032**	**$ 3.300.092**	**$ 101.138**	**$ 3.431.262**

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

Kategorie[2]	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	$ 1	$ 3.210.349	$ 57.311	$ 3.267.661
Investmentfonds	52.797	0	0	52.797
Pensionsgeschäfte	0	9.160	0	9.160
Finanzderivate[3]	5.730	14.061	(25)	19.766
Einlagen bei Kreditinstituten	0	0	2.227	2.227
Summen	**$ 58.528**	**$ 3.233.570**	**$ 59.513**	**$ 3.351.611**

(1) Weitere Informationen finden Sie in den Erläuterungen in Erläuterung 3.

(2) Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung des Wertpapierbestands.

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

Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2023:

Kontrahent	Kredit-zins	Abrechnungs-datum	Fälligkeits-datum	Kredit-betrag	Verbindlichkeiten aus umgekehrten Pensions-geschäften	% des Nettovermögens
BPS	5,450 %	17.04.2023	18.07.2023	$ (17.391)	$ (17.588)	(0,52)
	5,450	17.05.2023	18.07.2023	(12.705)	(12.791)	(0,38)
BRC	2,000	05.05.2023	TBD [1]	(3.019)	(3.037)	(0,09)
	3,750	05.05.2023	TBD [1]	(9.056)	(9.110)	(0,27)
	4,800	05.05.2023	TBD [1]	(1.579)	(1.588)	(0,05)
	8,750	05.10.2022	TBD [1]	ZAR (125.726)	(7.048)	(0,21)
MBC	2,800	03.07.2023	TBD [1]	€ (361)	(394)	(0,01)
	3,750	30.06.2023	TBD [1]	$ (1.582)	(1.583)	(0,04)
	4,700	30.06.2023	TBD [1]	(1.323)	(1.324)	(0,04)
NOM	4,900	22.06.2023	TBD [1]	(449)	(449)	(0,01)
Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte					**$ (54.912)**	**(1,62)**

(1) Umgekehrtes Pensionsgeschäft mit offener Laufzeit.

Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC-Finanzderivate und -Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2023 und 31. Dezember 2022:

	Zum 30. Jun. 2023			Zum 31. Dez. 2022		
Kontrahent	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-engagement[1]	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-engagement[1]
AZD	$ 1	$ 0	$ 1	$ 2	$ 0	$ 2
BOA	7.790	(6.230)	1.560	(9.485)	8.490	(995)
BPS	(167)	920	753	1.829	(690)	1.139
BRC	411	250	661	(897)	860	(37)
CBK	17.475	(16.700)	775	20.215	(19.290)	925
CLY	k. A.	k. A.	k. A.	(454)	0	(454)
DUB	1.494	(1.660)	(166)	126	(230)	(104)
FBF	k. A.	k. A.	k. A.	(33)	0	(33)
GLM	1.959	(1.770)	189	46	(120)	(74)
GST	313	(300)	13	(1.298)	1.330	32
HUS	36	(150)	(114)	58	(150)	(92)
IND	k. A.	k. A.	k. A.	0	270	270
JPM	343	(270)	73	1.107	(1.310)	(203)
MBC	(756)	710	(46)	3.472	(2.910)	562
MYC	869	(880)	(11)	(27)	(60)	(87)
MYI	711	(790)	(79)	70	(160)	(90)
RBC	35	0	35	1	0	1
RYL	k. A.	k. A.	k. A.	1.375	(1.300)	75
SCX	294	(280)	14	8.586	(8.150)	436
SOG	3.107	(2.300)	807	(37)	0	(37)
TOR	5	0	5	8	(20)	(12)
UAG	214	0	214	(678)	730	52

(1) Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären.

Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung des Wertpapierbestands zum 30. Juni 2023:

	30. Jun. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	87,53	83,54
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	10,96	15,12
Sonstige übertragbare Wertpapiere	0,29	0,17
Investmentfonds	0,89	1,60
Pensionsgeschäfte	k. A.	0,28
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	(0,16)	0,01
Zentral abgerechnete Finanzderivate	(0,02)	(0,14)
Freiverkehrsfinanzderivate	1,01	0,73
Einlagenzertifikate	0,73	0,07
Umgekehrte Pensionsgeschäfte	(1,62)	(2,28)

Das Anlageportfolio des Fonds konzentriert sich zum 30. Juni 2023 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	30. Jun. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
Albanien	0,09	0,09
Angola	0,42	0,19
Argentinien	1,98	1,46
Aserbaidschan	1,16	1,31
Bahamas	0,36	0,36
Bahrain	0,33	0,36
Weissrussland	k. A.	0,02
Benin	0,10	0,18
Brasilien	1,60	2,04
Kamerun	0,18	0,18
Kanada	0,03	k. A.
Cayman-Inseln	2,96	3,52
Chile	2,52	2,67
China	0,25	0,32
Kolumbien	2,17	2,78
Costa Rica	0,08	0,27
Dominikanische Republik	3,96	2,69
Ecuador	0,74	1,11
Ägypten	1,82	2,10
El Salvador	0,39	0,28
Äthiopien	0,07	0,06
Gabun	0,02	k. A.
Georgien	0,01	0,01
Deutschland	k. A.	0,33
Ghana	0,58	0,74
Guatemala	0,88	0,68
Hongkong	1,13	0,83
Ungarn	2,10	0,96
Indien	0,25	0,30
Indonesien	4,22	4,75
International	0,24	k. A.
Irland	0,73	0,73
Israel	2,02	1,74
Elfenbeinküste	0,36	0,67
Jamaika	0,08	0,08
Japan	0,48	0,50
Jersey, Kanalinseln	0,73	0,71
Jordanien	0,88	0,72
Kasachstan	1,13	1,37
Kenia	0,14	0,03
Libanon	0,02	0,02
Luxemburg	1,61	0,45
Mazedonien	0,25	k. A.
Malaysia	1,42	0,33
Mauritius	0,01	0,08
Mexiko	7,62	6,66
Mongolei	k. A.	0,05
Marokko	0,36	0,51
Multinational	0,27	0,28
Namibia	0,17	0,17
Niederlande	0,60	0,61
Nigeria	1,92	1,62
Oman	1,62	1,73
Pakistan	0,35	0,34
Panama	1,97	1,59
Paraguay	0,45	0,35
Peru	1,52	1,17
Philippinen	0,60	0,42
Polen	1,00	0,38
Katar	2,04	1,66
Rumänien	2,15	1,80
Russland	0,28	0,22
Saudi-Arabien	4,45	2,32
Senegal	0,44	0,23
Serbien	1,03	0,69

Anlagen zum Marktwert	30. Jun. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
Singapur	0,54	0,50
Südafrika	4,68	4,48
Südkorea	0,66	k. A.
Spanien	0,39	0,41
Sri Lanka	0,75	0,50
Supranational	0,21	0,21
Schweiz	0,34	0,82
Tansania	0,36	0,50
Thailand	0,06	0,10
Tunesien	0,24	0,28
Türkei	5,22	5,16
Ukraine	0,29	0,27
Vereinigte Arabische Emirate	2,29	1,89
Großbritannien	1,40	2,07
USA	11,13	9,86
Usbekistan	0,20	0,21
Venezuela	0,34	0,40
Vietnam	0,01	0,02
Jungferninseln (Britisch)	0,13	0,64
Sambia	0,10	0,11
Kurzfristige Instrumente	0,10	9,58
Investmentfonds	0,89	1,60
Pensionsgeschäfte	k. A.	0,28
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	(0,16)	0,01
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen — Schutzkauf	k. A.	0,00
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen — Schutzverkauf	0,00	0,00
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzkauf	(0,01)	k. A.
Credit Default Swaps auf Kreditindizes— Schutzverkauf	k. A.	(0,02)
Zinsswaps	(0,01)	(0,12)
Freiverkehrsfinanzderivate		
Verkaufsoptionen		
Zinsswapoptionen	0,00	k. A.
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen — Schutzkauf	0,06	0,08
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen — Schutzverkauf	0,13	(0,11)
Volatilitätsswaps	k. A.	0,00
Devisenterminkontrakte	0,20	(0,14)
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	0,62	0,90
Einlagenzertifikate	0,73	0,07
Sonstige Aktiva und Passiva	(1,23)	(1,38)
Nettovermögen	100,00	100,00

Aufstellung des Wertpapierbestands des Emerging Markets Bond ESG Fund

BESCHREIBUNG		PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE				
ARGENTINIEN				
STAATSEMISSIONEN				
Argentina Government International Bond				
0,500 % fällig am 09.07.2030	$	20.662	$ 6.900	0,29
1,000 % fällig am 09.07.2029		7.494	2.450	0,10
1,500 % fällig am 09.07.2035		25.179	7.594	0,32
3,500 % fällig am 09.07.2041		102.729	33.081	1,40
3,875 % fällig am 09.01.2038		11.113	3.927	0,17
Provincia de la Rioja				
6,500 % fällig am 24.02.2028 ^		425	227	0,01
Provincia de Neuquen				
6,625 % fällig am 27.04.2030 ^		320	228	0,01
Summe Argentinien			54.407	2,30
ARMENIEN				
STAATSEMISSIONEN				
Republic of Armenien Government International Bond				
3,600 % fällig am 02.02.2031		7.700	6.055	0,25
3,950 % fällig am 26.09.2029		800	666	0,03
Summe Armenien			6.721	0,28
BAHAMAS				
STAATSEMISSIONEN				
Bahamas Government International Bond				
6,000 % fällig am 21.11.2028		6.700	5.411	0,23
9,000 % fällig am 16.06.2029		3.400	3.025	0,13
Summe Bahamas			8.436	0,36
BAHRAIN				
STAATSEMISSIONEN				
Bahrain Government International Bond				
4,250 % fällig am 25.01.2028		15.000	13.873	0,59
5,250 % fällig am 25.01.2033		3.000	2.619	0,11
5,625 % fällig am 30.09.2031		5.900	5.471	0,23
6,000 % fällig am 19.09.2044		1.300	1.038	0,04
Summe Bahrain			23.001	0,97
BENIN				
STAATSEMISSIONEN				
Benin Government International Bond				
4,950 % fällig am 22.01.2035	€	13.500	10.449	0,44
BERMUDA				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Star Energy Geothermal Darajat				
4,850 % fällig am 14.10.2038	$	3.800	3.442	0,15
BRASILIEN				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Brazil Minas SPE Via State of Minas Gerais				
5,333 % fällig am 15.02.2028		11.305	11.105	0,47
CSN Inova Ventures				
6,750 % fällig am 28.01.2028		8.500	7.894	0,33
Rede D'or Finance SARL				
4,500 % fällig am 22.01.2030		263	224	0,01
Suzano Austria GmbH				
3,125 % fällig am 15.01.2032		3.000	2.403	0,10
			21.626	0,91
STAATSEMISSIONEN				
Brazil Government International Bond				
4,250 % fällig am 07.01.2025		300	295	0,01
4,750 % fällig am 14.01.2050		21.275	15.716	0,67
5,000 % fällig am 27.01.2045		5.395	4.219	0,18
			20.230	0,86
Summe Brasilien			41.856	1,77
BULGARIEN				
STAATSEMISSIONEN				
Bulgaria Government International Bond				
4,500 % fällig am 27.01.2033	€	5.400	5.848	0,25

BESCHREIBUNG		PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
CAYMAN INSELN				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
AAC Technologies Holdings, Inc.				
2,625 % fällig am 02.06.2026	$	6.800	$ 5.960	0,25
Alibaba Group Holding Ltd.				
2,700 % fällig am 09.02.2041		5.000	3.344	0,14
Baidu, Inc.				
2,375 % fällig am 23.08.2031		1.900	1.537	0,07
Bioceanico Sovereign Certificate Ltd.				
0,000 % fällig am 05.06.2034 (b)		4.809	3.365	0,14
CIFI Holdings Group Co. Ltd.				
4,450 % fällig am 17.08.2026 ^		2.900	329	0,01
Country Garden Holdings Co. Ltd.				
2,700 % fällig am 12.07.2026		2.300	704	0,03
3,875 % fällig am 22.10.2030		1.800	515	0,02
Hongkong Land Finance Cayman Islands Co. Ltd.				
2,250 % fällig am 15.07.2031		13.000	10.640	0,45
ICD Funding Ltd.				
3,223 % fällig am 28.04.2026		400	374	0,02
IHS Holding Ltd.				
5,625 % fällig am 29.11.2026		1.500	1.313	0,06
Interoceanica Finance Ltd.				
0,000 % fällig am 30.11.2025 (b)		338	311	0,01
7,860 % fällig am 15.05.2030		2.655	2.522	0,11
Kaisa Group Holdings Ltd.				
9,375 % fällig am 30.06.2024 ^		1.850	123	0,01
9,750 % fällig am 28.09.2023 ^		300	20	0,00
11,250 % fällig am 09.04.2022 ^		1.000	67	0,00
11,500 % fällig am 30.01.2023 ^		200	13	0,00
11,650 % fällig am 01.06.2026 ^		3.600	241	0,01
11,700 % fällig am 11.11.2025 ^		1.450	97	0,00
11,950 % fällig am 12.11.2023 ^		300	24	0,00
Lima Metro Line Finance Ltd.				
5,875 % fällig am 05.07.2034		459	447	0,02
MAF Sukuk Ltd.				
4,638 % fällig am 14.05.2029		3.600	3.526	0,15
Powerlong Real Estate Holdings Ltd.				
5,950 % fällig am 30.04.2025		3.400	352	0,02
Sunac China Holdings Ltd.				
5,950 % fällig am 26.04.2024 ^		1.500	225	0,01
6,500 % fällig am 10.01.2025 ^		700	106	0,00
7,000 % fällig am 09.07.2025 ^		3.500	529	0,02
Xiaomi Best Time International Ltd.				
4,100 % fällig am 14.07.2051		11.900	7.054	0,30
Zhongsheng Group Holdings Ltd.				
3,000 % fällig am 13.01.2026		1.000	912	0,04
Summe Cayman Inseln			44.650	1,89
CHILE				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Banco Santander Chile				
2,700 % fällig am 10.01.2025		2.250	2.153	0,09
Corp. Nacional del Cobre de Chile				
3,150 % fällig am 14.01.2030		1.050	932	0,04
3,625 % fällig am 01.08.2027		600	567	0,02
3,700 % fällig am 30.01.2050		700	531	0,02
4,375 % fällig am 05.02.2049		200	169	0,01
4,500 % fällig am 01.08.2047		500	427	0,02
4,875 % fällig am 04.11.2044		300	271	0,01
5,125 % fällig am 02.02.2033		3.900	3.851	0,16
Empresa de los Ferrocarriles del Estado				
3,068 % fällig am 18.08.2050		600	367	0,02
3,830 % fällig am 14.09.2061		2.300	1.569	0,07
Sociedad Quimica y Minera de Chile S.A.				
4,250 % fällig am 07.05.2029		1.600	1.524	0,06
			12.361	0,52
STAATSEMISSIONEN				
Chile Government International Bond				
2,550 % fällig am 27.01.2032 (g)		4.000	3.425	0,15
3,100 % fällig am 07.05.2041		15.400	11.596	0,49
3,100 % fällig am 22.01.2061		7.900	5.180	0,22
3,250 % fällig am 21.09.2071		4.800	3.126	0,13
3,500 % fällig am 25.01.2050		5.600	4.220	0,18
3,500 % fällig am 15.04.2053 (g)		8.900	6.651	0,28

BESCHREIBUNG		PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
4,340 % fällig am 07.03.2042	$	7.700	$ 6.855	0,29
			41.053	1,74
Summe Chile			53.414	2,26
CHINA				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Yango Justice International Ltd.				
7,500 % fällig am 17.02.2025 ^		3.300	29	0,00
7,875 % fällig am 04.09.2024 ^		2.000	30	0,00
Summe China			59	0,00
KOLUMBIEN				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Banco Davivienda S.A.				
6,650 % fällig am 22.04.2031 (c)(d)		6.720	4.952	0,21
STAATSEMISSIONEN				
Colombia Government International Bond				
3,000 % fällig am 30.01.2030		300	234	0,01
3,125 % fällig am 15.04.2031		4.200	3.177	0,13
3,875 % fällig am 25.04.2027		4.000	3.636	0,15
3,875 % fällig am 15.02.2061		9.700	5.454	0,23
4,125 % fällig am 15.05.2051 (g)		18.300	10.997	0,47
4,500 % fällig am 28.01.2026		5.200	4.963	0,21
5,000 % fällig am 15.06.2045		1.100	769	0,03
5,200 % fällig am 15.05.2049		7.700	5.309	0,22
5,625 % fällig am 26.02.2044		1.000	747	0,03
6,125 % fällig am 18.01.2041		1.300	1.062	0,05
7,375 % fällig am 18.09.2037		3.865	3.682	0,16
7,500 % fällig am 02.02.2034		12.510	12.265	0,52
8,000 % fällig am 20.04.2033		5.000	5.086	0,22
10,375 % fällig am 28.01.2033		1.350	1.561	0,07
			58.942	2,50
Summe Kolumbien			63.894	2,71
COSTA RICA				
STAATSEMISSIONEN				
Costa Rica Government International Bond				
5,625 % fällig am 30.04.2043		18.950	16.327	0,69
6,550 % fällig am 03.04.2034		1.500	1.508	0,07
7,158 % fällig am 12.03.2045 (g)		2.400	2.383	0,10
Summe Costa Rica			20.218	0,86
ZYPERN				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Atrium Finance PLC				
2,625 % fällig am 05.09.2027	€	8.000	6.363	0,27
DOMINIKANISCHE REPUBLIK				
STAATSEMISSIONEN				
Zentralbanknoten der Dominikanischen Republik				
12,000 % fällig am 03.10.2025	DO P	36.900	701	0,03
13,000 % fällig am 05.12.2025		647.400	12.630	0,54
13,000 % fällig am 30.01.2026		222.500	4.353	0,18
Dominican Republic Government International Bond				
4,500 % fällig am 30.01.2030	$	3.000	2.637	0,11
5,300 % fällig am 21.01.2041		8.800	6.917	0,29
5,500 % fällig am 27.01.2025		2.500	2.464	0,10
5,500 % fällig am 22.02.2029		11.200	10.508	0,45
5,875 % fällig am 30.01.2060		32.500	25.267	1,07
5,950 % fällig am 25.01.2027		8.400	8.254	0,35
6,000 % fällig am 19.07.2028		1.520	1.485	0,06
6,000 % fällig am 22.02.2033		1.700	1.572	0,07
6,400 % fällig am 05.06.2049		2.500	2.136	0,09
6,500 % fällig am 15.02.2048		200	173	0,01
6,850 % fällig am 27.01.2045		3.100	2.822	0,12
6,875 % fällig am 29.01.2026		4.500	4.543	0,19
13,625 % fällig am 03.02.2033	DO P	500.900	11.263	0,48
13,625 % fällig am 10.02.2034		277.400	6.335	0,27
Summe Dominikanische Republik			104.060	4,41

BESCHREIBUNG		PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
ECUADOR				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Ecuador Social Bond SARL				
0,000 % fällig am 30.01.2035 (b)	$	11.937	$ 9.073	0,38
STAATSEMISSIONEN				
Ecuador Government International Bond				
0,000 % fällig am 31.07.2030 (b)		5.886	1.712	0,07
1,500 % fällig am 31.07.2040		4.527	1.419	0,06
2,500 % fällig am 31.07.2035		56.088	19.627	0,83
5,500 % fällig am 31.07.2030		11.934	5.802	0,25
			28.560	1,21
Summe Ecuador			37.633	1,59
ÄGYPTEN				
STAATSEMISSIONEN				
Egypt Government International Bond				
5,250 % fällig am 06.10.2025		7.500	5.728	0,24
5,625 % fällig am 16.04.2030	€	1.100	668	0,03
5,875 % fällig am 16.02.2031	$	3.800	2.102	0,09
6,375 % fällig am 11.04.2031	€	11.200	6.821	0,29
7,053 % fällig am 15.01.2032	$	6.200	3.532	0,15
7,300 % fällig am 30.09.2033		6.000	3.320	0,14
7,500 % fällig am 16.02.2061		8.400	4.236	0,18
7,625 % fällig am 29.05.2032		8.800	5.135	0,22
7,903 % fällig am 21.02.2048		4.300	2.220	0,09
8,150 % fällig am 20.11.2059		3.500	1.822	0,08
8,500 % fällig am 31.01.2047		3.400	1.815	0,07
8,750 % fällig am 30.09.2051		7.400	4.012	0,17
Summe Ägypten			41.411	1,75
EL SALVADOR				
STAATSEMISSIONEN				
El Salvador Government International Bond				
6,375 % fällig am 18.01.2027		3.600	2.529	0,11
7,125 % fällig am 20.01.2050		14.900	8.329	0,35
7,625 % fällig am 21.09.2034		1.100	644	0,03
7,625 % fällig am 01.02.2041		250	143	0,01
7,650 % fällig am 15.06.2035		1.000	594	0,02
9,500 % fällig am 15.07.2052		7.750	4.914	0,21
Summe El Salvador			17.153	0,73
GABUN				
STAATSEMISSIONEN				
Gabon Government International Bond				
6,625 % fällig am 06.02.2031		600	479	0,02
7,000 % fällig am 24.11.2031		1.300	1.035	0,04
Summe Gabun			1.514	0,06
GEORGIEN				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Georgian Railway JSC				
4,000 % fällig am 17.06.2028		10.700	9.279	0,39
GHANA				
STAATSEMISSIONEN				
Ghana Government International Bond				
0,000 % fällig am 07.04.2025 ^		1.400	539	0,02
7,625 % fällig am 16.05.2029 ^		3.300	1.422	0,06
7,750 % fällig am 07.04.2029 ^		2.700	1.162	0,05
7,875 % fällig am 11.02.2035 ^		5.700	2.494	0,11
8,125 % fällig am 26.03.2032 ^		11.300	4.882	0,21
8,625 % fällig am 07.04.2034 ^		7.900	3.403	0,14
8,627 % fällig am 16.06.2049 ^		1.600	663	0,03
8,750 % fällig am 11.03.2061 ^		31.850	13.287	0,56
8,875 % fällig am 07.05.2042 ^		1.100	455	0,02
8,950 % fällig am 26.03.2051 ^		6.700	2.810	0,12
Summe Ghana			31.117	1,32
GUERNSEY, KANALINSELN				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Globalworth Real Estate Investments Ltd.				
2,950 % fällig am 29.07.2026	€	3.500	2.879	0,12

BESCHREIBUNG		PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
HONGKONG				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
AIA Group Ltd.				
3,200 % fällig am 16.09.2040	$	200	$ 154	0,01
Fortune Star BVI Ltd.				
3,950 % fällig am 02.10.2026	€	1.500	1.129	0,04
5,000 % fällig am 18.05.2026	$	200	150	0,01
5,050 % fällig am 27.01.2027		200	138	0,01
5,950 % fällig am 19.10.2025		4.000	3.206	0,13
Huarong Finance Co. Ltd.				
3,875 % fällig am 13.11.2029		900	695	0,03
4,500 % fällig am 29.05.2029		4.200	3.371	0,14
4,750 % fällig am 27.04.2027		800	693	0,03
4,950 % fällig am 07.11.2047		1.700	1.134	0,05
Lenovo Group Ltd.				
3,421 % fällig am 02.11.2030		1.500	1.265	0,05
6,536 % fällig am 27.07.2032		6.800	6.865	0,29
MTR Corp. Ltd.				
1,625 % fällig am 19.08.2030		6.300	5.178	0,22
			23.978	1,01
STAATSEMISSIONEN				
Airport Authority Hong Kong				
2,100 % fällig am 08.03.2026 (c)		1.800	1.647	0,07
2,400 % fällig am 08.03.2028 (c)		3.600	3.173	0,13
2,500 % fällig am 12.01.2032		200	170	0,01
4,875 % fällig am 12.01.2030		6.500	6.610	0,28
Hong Kong Government International Bond				
2,375 % fällig am 02.02.2051		1.200	816	0,03
3,750 % fällig am 07.06.2032	€	5.500	6.044	0,26
5,250 % fällig am 11.01.2053	$	3.500	3.916	0,17
			22.376	0,95
Summe Hongkong			46.354	1,96
UNGARN				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
MVM Energetika Zrt				
7,500 % fällig am 09.06.2028		4.400	4.392	0,18
STAATSEMISSIONEN				
Ungarische Entwicklungsbank				
6,500 % fällig am 29.06.2028		10.900	10.810	0,46
Hungary Government International Bond				
1,625 % fällig am 28.04.2032	€	1.200	997	0,04
1,750 % fällig am 05.06.2035		8.400	6.439	0,27
2,125 % fällig am 22.09.2031	$	18.650	14.460	0,61
3,125 % fällig am 21.09.2051		7.600	4.742	0,20
5,250 % fällig am 16.06.2029		11.600	11.311	0,48
5,375 % fällig am 25.03.2024		200	200	0,01
5,500 % fällig am 16.06.2034		1.700	1.655	0,07
6,750 % fällig am 25.09.2052		16.600	17.168	0,73
7,625 % fällig am 29.03.2041		500	565	0,02
Magyar Export-Import Bank				
6,125 % fällig am 04.12.2027		7.500	7.428	0,32
			75.775	3,21
Summe Ungarn			80.167	3,39
INDIEN				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Adani Renewable Energy RJ Ltd.				
4,625 % fällig am 15.10.2039		3.916	2.871	0,12
Indian Railway Finance Corp. Ltd.				
3,570 % fällig am 21.01.2032		10.300	8.989	0,38
3,835 % fällig am 13.12.2027		3.500	3.269	0,14
JSW Hydro Energy Ltd.				
4,125 % fällig am 18.05.2031		3.990	3.370	0,14
ReNew Power Pvt Ltd.				
5,875 % fällig am 05.03.2027		1.202	1.127	0,05
ReNew Wind Energy AP2				
4,500 % fällig am 14.07.2028		10.000	8.532	0,36
Wipro IT Services LLC				
1,500 % fällig am 23.06.2026		5.000	4.461	0,19
Summe Indien			32.619	1,38
INDONESIEN				

BESCHREIBUNG		PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Bank Mandiri Persero Tbk PT				
2,000 % fällig am 19.04.2026	$	6.700	$ 6.060	0,26
3,750 % fällig am 11.04.2024		2.000	1.967	0,08
Pelabuhan Indonesia Persero PT				
4,250 % fällig am 05.05.2025		6.700	6.539	0,28
5,375 % fällig am 05.05.2045		3.000	2.832	0,12
Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia				
4,700 % fällig am 06.06.2032		18.100	17.975	0,76
			35.373	1,50
STAATSEMISSIONEN				
Indonesia Government International Bond				
1,100 % fällig am 12.03.2033	€	1.700	1.381	0,06
1,300 % fällig am 23.03.2034		11.400	9.184	0,39
4,750 % fällig am 18.07.2047	$	4.400	4.159	0,17
5,125 % fällig am 15.01.2045		4.164	4.152	0,17
5,250 % fällig am 08.01.2047		200	200	0,01
5,650 % fällig am 11.01.2053		700	734	0,03
7,750 % fällig am 17.01.2038		3.280	4.107	0,17
8,500 % fällig am 12.10.2035		1.055	1.376	0,06
Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia				
3,550 % fällig am 09.06.2051		5.500	4.191	0,18
3,800 % fällig am 23.06.2050		3.500	2.771	0,12
			32.255	1,36
Summe Indonesien			67.628	2,86
INTERNATIONALE				
KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG				
Project Mercury				
TBD % fällig am 17.07.2030	€	4.800	5.237	0,22
IRLAND				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Alfa Bank AO Via Alfa Bond Issuance PLC				
5,950 % fällig am 15.04.2030 ^(d)	$	3.900	234	0,01
Phosagro OAO Via Phosagro Bond Funding DAC				
3,949 % fällig am 24.04.2023 ^		1.700	1.556	0,06
Sovcombank Via SovCom Capital DAC				
3,400 % fällig am 26.01.2025 ^		5.400	146	0,01
Summe Irland			1.936	0,08
ELFENBEINKÜSTE				
KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG				
Elfenbeinküste				
7,985 % fällig am 19.03.2027	€	1.200	1.277	0,05
STAATSEMISSIONEN				
Ivory Coast Government International Bond				
5,250 % fällig am 22.03.2030		19.900	18.401	0,78
5,875 % fällig am 17.10.2031		600	549	0,02
6,625 % fällig am 22.03.2048		2.900	2.253	0,10
			21.203	0,90
Summe Elfenbeinküste			22.480	0,95
JAMAIKA				
STAATSEMISSIONEN				
Jamaica Government International Bond				
7,875 % fällig am 28.07.2045	$	3.300	3.816	0,16
JERSEY, KANALINSELN				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Corsair International Ltd.				
7,772 % fällig am 28.01.2027	€	7.900	8.576	0,36
8,122 % fällig am 28.01.2029		3.400	3.681	0,16
Summe Jersey, Kanalinseln			12.257	0,52
JORDANIEN				
STAATSEMISSIONEN				
Jordan Government International Bond				
5,750 % fällig am 31.01.2027	$	300	289	0,01
6,125 % fällig am 29.01.2026		3.000	2.949	0,12

BESCHREIBUNG		PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
7,375 % fällig am 10.10.2047	$	7.300	$ 6.312	0,27
7,500 % fällig am 13.01.2029		6.000	6.049	0,26
Summe Jordanien			15.599	0,66
KASACHSTAN				
STAATSEMISSIONEN				
Kazakhstan Government International Bond				
4,875 % fällig am 14.10.2044		5.600	5.060	0,21
6,500 % fällig am 21.07.2045		21.800	23.068	0,98
Summe Kasachstan			28.128	1,19
KENIA				
STAATSEMISSIONEN				
Kenya Government International Bond				
6,300 % fällig am 23.01.2034		6.200	4.699	0,20
6,875 % fällig am 24.06.2024		9.400	8.964	0,38
Summe Kenia			13.663	0,58
LUXEMBURG				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Amaggi Luxembourg International SARL				
5,250 % fällig am 28.01.2028		6.000	5.465	0,23
Unigel Luxembourg S.A.				
8,750 % fällig am 01.10.2026		3.400	1.118	0,05
Summe Luxemburg			6.583	0,28
MAZEDONIEN				
STAATSEMISSIONEN				
North Macedonia Government International Bond				
2,750 % fällig am 18.01.2025	€	3.600	3.749	0,16
5,625 % fällig am 26.07.2023		5.800	6.333	0,27
6,960 % fällig am 13.03.2027		6.700	7.471	0,31
Summe Mazedonien			17.553	0,74
MALAYSIA				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Axiata SPV5 Labuan Ltd.				
3,064 % fällig am 19.08.2050	$	4.600	3.214	0,14
Khazanah Capital Ltd.				
4,876 % fällig am 01.06.2033		4.300	4.260	0,18
Khazanah Global Sukuk Bhd.				
4,687 % fällig am 01.06.2028		5.800	5.725	0,24
			13.199	0,56
STAATSEMISSIONEN				
Malaysia Government International Bond				
3,800 % fällig am 17.08.2023	MYR	74.400	15.953	0,67
Summe Malaysia			29.152	1,23
MAURITIUS				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Greenko Solar Mauritius Ltd.				
5,950 % fällig am 29.07.2026	$	200	188	0,01
India Green Energy Holdings				
5,375 % fällig am 29.04.2024		9.400	9.192	0,39
Summe Mauritius			9.380	0,40
MEXIKO				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Banco Mercantil del Norte S.A.				
6,625 % fällig am 24.01.2032 (c)(d)		2.000	1.548	0,07
7,500 % fällig am 27.06.2029 (c)(d)		3.400	2.955	0,12
7,625 % fällig am 10.01.2028 (c)(d)		300	273	0,01
8,375 % fällig am 14.10.2030 (c)(d)		400	374	0,02
Corp. GEO S.A.B. de C.V.				
8,875 % fällig am 25.09.2014 ^		500	0	0,00
Metalsa S.A. de C.V.				
3,750 % fällig am 04.05.2031		10.600	8.356	0,35
Sitios Latinoamerica S.A.B. de C.V.				
5,375 % fällig am 04.04.2032		6.500	5.893	0,25
Trust Fibra Uno				
6,390 % fällig am 15.01.2050	$	2.000	$ 1.584	0,07
			20.983	0,89
STAATSEMISSIONEN				
Mexico Government International Bond				
1,350 % fällig am 18.09.2027	€	600	594	0,03
2,250 % fällig am 12.08.2036		9.700	7.852	0,33
2,659 % fällig am 24.05.2031	$	0	0	0,00
3,750 % fällig am 19.04.2071		3.700	2.477	0,11
3,771 % fällig am 24.05.2061		0	0	0,00
4,875 % fällig am 19.05.2033		18.800	17.974	0,76
5,750 % fällig am 12.10.2110		18.340	16.413	0,69
6,338 % fällig am 04.05.2053		3.900	3.983	0,17
6,350 % fällig am 09.02.2035		0	0	0,00
			49.293	2,09
Summe Mexiko			70.276	2,98
MONGOLEI				
STAATSEMISSIONEN				
Mongolia Government International Bond				
3,500 % fällig am 07.07.2027		7.200	6.022	0,26
5,125 % fällig am 07.04.2026		1.100	1.026	0,04
8,650 % fällig am 19.01.2028		268	270	0,01
Summe Mongolei			7.318	0,31
MAROKKO				
STAATSEMISSIONEN				
Morocco Government International Bond				
4,000 % fällig am 15.12.2050		17.000	11.471	0,48
5,500 % fällig am 11.12.2042		4.600	3.970	0,17
Summe Marokko			15.441	0,65
MULTINATIONAL				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
NXP BV				
3,400 % fällig am 01.05.2030		500	443	0,02
NAMIBIA				
STAATSEMISSIONEN				
Namibia Government International Bond				
5,250 % fällig am 29.10.2025		2.300	2.190	0,09
NIEDERLANDE				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
IHS Netherlands Holdco BV				
8,000 % fällig am 18.09.2027		10.700	9.780	0,41
ING Groep NV				
1,125 % fällig am 07.12.2028	£	4.000	3.992	0,17
1,400 % fällig am 01.07.2026	$	7.900	7.197	0,31
InterCement Financial Operations BV				
5,750 % fällig am 17.07.2024		200	125	0,01
Metinvest BV				
8,500 % fällig am 23.04.2026		1.100	759	0,03
NE Property BV				
2,000 % fällig am 20.01.2030	€	5.600	4.521	0,19
3,375 % fällig am 14.07.2027		2.300	2.255	0,10
Prosus NV				
1,539 % fällig am 03.08.2028		800	720	0,03
2,031 % fällig am 03.08.2032		400	311	0,01
3,257 % fällig am 19.01.2027	$	2.200	1.989	0,08
4,027 % fällig am 03.08.2050		800	503	0,02
Summe Niederlande			32.152	1,36
OMAN				
STAATSEMISSIONEN				
Oman Government International Bond				
4,750 % fällig am 15.06.2026		4.600	4.479	0,19
4,875 % fällig am 01.02.2025		3.000	2.956	0,13
5,375 % fällig am 08.03.2027		5.600	5.504	0,23
5,625 % fällig am 17.01.2028		8.200	8.126	0,34
6,000 % fällig am 01.08.2029		12.300	12.328	0,52
6,250 % fällig am 25.01.2031		6.200	6.303	0,27
6,500 % fällig am 08.03.2047		2.650	2.478	0,11
6,750 % fällig am 28.10.2027		14.400	14.903	0,63
6,750 % fällig am 17.01.2048	$	6.700	$ 6.454	0,27
7,000 % fällig am 25.01.2051		4.800	4.764	0,20
Summe Oman			68.295	2,89
PANAMA				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Aeropuerto Internacional de Tocumen S.A.				
5,125 % fällig am 11.08.2061		2.900	2.239	0,10
Banco General S.A.				
5,250 % fällig am 07.05.2031 (c)		6.500	5.620	0,24
Banco Nacional de Panamá				
2,500 % fällig am 11.08.2030		600	473	0,02
Empresa de Transmision Electrica S.A.				
5,125 % fällig am 02.05.2049		1.000	813	0,03
			9.145	0,39
STAATSEMISSIONEN				
Panama Government International Bond				
2,252 % fällig am 29.09.2032		3.300	2.530	0,11
3,160 % fällig am 23.01.2030		800	702	0,03
3,870 % fällig am 23.07.2060		8.500	5.655	0,24
4,300 % fällig am 29.04.2053		1.500	1.120	0,05
4,500 % fällig am 15.05.2047		4.200	3.351	0,14
4,500 % fällig am 16.04.2050		9.800	7.619	0,32
4,500 % fällig am 01.04.2056		15.000	11.302	0,48
4,500 % fällig am 19.01.2063		18.500	13.581	0,57
6,400 % fällig am 14.02.2035		10.600	11.081	0,47
6,700 % fällig am 26.01.2036		6.500	6.976	0,29
6,853 % fällig am 28.03.2054		2.700	2.816	0,12
8,125 % fällig am 28.04.2034		1.000	1.184	0,05
			67.917	2,87
Summe Panama			77.062	3,26
PARAGUAY				
STAATSEMISSIONEN				
Paraguay Government International Bond				
2,739 % fällig am 29.01.2033		1.900	1.524	0,06
3,849 % fällig am 28.06.2033		1.900	1.654	0,07
4,700 % fällig am 27.03.2027		2.300	2.240	0,10
5,400 % fällig am 30.03.2050		15.200	13.023	0,55
5,600 % fällig am 13.03.2048		1.800	1.583	0,07
5,850 % fällig am 21.08.2033 (a)		2.700	2.704	0,11
6,100 % fällig am 11.08.2044		1.800	1.709	0,07
Summe Paraguay			24.437	1,03
PERU				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
InRetail Consumer				
3,250 % fällig am 22.03.2028		3.700	3.181	0,14
STAATSEMISSIONEN				
Fondo MIVIVIENDA S.A.				
4,625 % fällig am 12.04.2027		12.100	11.701	0,49
Peru Government International Bond				
1,950 % fällig am 17.11.2036	€	8.300	6.568	0,28
3,000 % fällig am 15.01.2034	$	7.700	6.416	0,27
3,230 % fällig am 28.07.2121		0	0	0,00
3,600 % fällig am 15.01.2072		8.200	5.611	0,24
6,550 % fällig am 14.03.2037		0	0	0,00
			30.296	1,28
Summe Peru			33.477	1,42
PHILIPPINEN				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Globe Telecom, Inc.				
4,200 % fällig am 02.08.2026 (c)		6.700	6.239	0,27
PLDT, Inc.				
3,450 % fällig am 23.06.2050		3.900	2.662	0,11
			8.901	0,38
STAATSEMISSIONEN				
Philippines Government International Bond				
2,650 % fällig am 10.12.2045		1.800	1.215	0,05
2,950 % fällig am 05.05.2045		10.500	7.496	0,32
3,200 % fällig am 06.07.2046		4.200	3.109	0,13

BESCHREIBUNG		PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
3,700 % fällig am 01.03.2041	$	300	$ 247	0,01
5,500 % fällig am 17.01.2048		10.600	10.890	0,46
6,375 % fällig am 23.10.2034		800	895	0,04
9,500 % fällig am 02.02.2030		1.100	1.381	0,06
			25.233	1,07
Summe Philppinen			34.134	1,45
POLEN				
STAATSEMISSIONEN				
Bank Gospodarstwo Krajowego				
5,375 % fällig am 22.05.2033		3.800	3.785	0,16
Poland Government International Bond				
4,875 % fällig am 04.10.2033		11.200	11.015	0,47
5,500 % fällig am 16.11.2027		6.700	6.883	0,29
5,500 % fällig am 04.04.2053		11.500	11.603	0,49
Summe Polen			33.286	1,41
KATAR				
STAATSEMISSIONEN				
Qatar Government International Bond				
4,400 % fällig am 16.04.2050		21.100	19.239	0,81
4,500 % fällig am 23.04.2028		7.000	7.014	0,30
4,817 % fällig am 14.03.2049		12.465	12.005	0,51
5,103 % fällig am 23.04.2048		1.000	999	0,04
Summe Katar			39.257	1,66
RUMÄNIEN				
STAATSEMISSIONEN				
Romania Government International Bond				
1,750 % fällig am 13.07.2030 (g)	€	4.200	3.503	0,15
2,000 % fällig am 08.12.2026		300	299	0,01
2,000 % fällig am 14.04.2033		11.300	8.732	0,37
2,124 % fällig am 16.07.2031 (g)		31.610	26.227	1,11
2,124 % fällig am 16.07.2031		1.500	1.245	0,05
2,125 % fällig am 07.03.2028		4.600	4.366	0,18
2,625 % fällig am 02.12.2040		3.950	2.631	0,11
2,750 % fällig am 14.04.2041		7.800	5.236	0,22
2,875 % fällig am 13.04.2042		8.600	5.782	0,25
3,375 % fällig am 28.01.2050		6.200	4.254	0,18
3,500 % fällig am 03.04.2034		3.000	2.609	0,11
3,750 % fällig am 07.02.2034		950	840	0,04
4,125 % fällig am 11.03.2039		1.000	852	0,04
4,625 % fällig am 03.04.2049		2.200	1.856	0,08
5,000 % fällig am 27.09.2026		1.650	1.809	0,08
6,125 % fällig am 22.01.2044	$	1.200	1.160	0,05
6,625 % fällig am 27.09.2029	€	1.900	2.158	0,09
7,625 % fällig am 17.01.2053	$	8.600	9.474	0,40
Summe Rumänien			83.033	3,52
RUSSLAND				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
MMK International Capital DAC				
4,375 % fällig am 13.06.2024 ^		2.800	168	0,01
SENEGAL				
STAATSEMISSIONEN				
Senegal Government International Bond				
4,750 % fällig am 13.03.2028	€	1.200	1.131	0,05
5,375 % fällig am 08.06.2037		5.500	4.028	0,17
6,250 % fällig am 23.05.2033	$	5.600	4.702	0,20
Summe Senegal			9.861	0,42
SERBIEN				
STAATSEMISSIONEN				
Serbia Government International Bond				
1,000 % fällig am 23.09.2028	€	6.200	5.250	0,22
1,650 % fällig am 03.03.2033		12.400	9.028	0,38
2,125 % fällig am 01.12.2030	$	4.000	3.084	0,13
3,125 % fällig am 15.05.2027	€	7.300	7.165	0,30
6,500 % fällig am 26.09.2033	$	9.500	9.340	0,40
Summe Serbien			33.867	1,43
SINGAPUR				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Clean Renewable Power Mauritius Pte. Ltd.				
4,250 % fällig am 25.03.2027		5.208	4.577	0,19

BESCHREIBUNG		PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
Flex Ltd.				
4,875 % fällig am 15.06.2029	$	200	$ 191	0,01
United Overseas Bank Ltd.				
1,250 % fällig am 14.04.2026		6.500	5.844	0,25
Summe Singapur			10.612	0,45
SÜDAFRIKA				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Entwicklungsbank für das südliche Afrika				
8,600 % fällig am 21.10.2024 (f)	ZAR	253.300	13.178	0,56
STAATSEMISSIONEN				
South Africa Government International Bond				
4,850 % fällig am 30.09.2029	$	9.100	8.023	0,34
5,750 % fällig am 30.09.2049		21.800	15.486	0,65
10,500 % fällig am 21.12.2026	ZAR	565.700	31.099	1,32
			54.608	2,31
Summe Südafrika			67.786	2,87
SÜDKOREA				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Hana Bank				
3,500 % fällig am 19.10.2026 (c)(d)	$	6.500	5.820	0,25
Hanwha Life Insurance Co. Ltd.				
3,379 % fällig am 04.02.2032		6.700	6.004	0,25
Hyundai Capital Services, Inc.				
1,250 % fällig am 08.02.2026		8.200	7.317	0,31
KB Kookmin Card Co. Ltd.				
1,500 % fällig am 13.05.2026		10.000	8.858	0,37
4,000 % fällig am 09.06.2025		7.900	7.594	0,32
Kodit Global Co. Ltd.				
4,954 % fällig am 25.05.2026		1.200	1.182	0,05
Kookmin Bank				
2,500 % fällig am 04.11.2030 (d)		2.500	2.031	0,09
Mirae Asset Securities Co. Ltd.				
1,375 % fällig am 07.07.2024		17.600	16.674	0,71
NongHyup Bank				
1,250 % fällig am 28.07.2026		13.000	11.418	0,48
Shinhan Bank Co. Ltd.				
4,375 % fällig am 13.04.2032 (d)		9.000	8.208	0,35
Shinhan Card Co. Ltd.				
1,375 % fällig am 19.10.2025		3.000	2.714	0,11
1,375 % fällig am 23.06.2026		3.000	2.637	0,11
Shinhan Financial Group Co. Ltd.				
2,875 % fällig am 12.05.2026 (c)(d)		8.000	7.050	0,30
3,340 % fällig am 05.02.2030 (d)		5.100	4.885	0,21
SK Hynix, Inc.				
2,375 % fällig am 19.01.2031		5.300	4.091	0,17
Woori Card Co. Ltd.				
1,750 % fällig am 23.03.2026		6.000	5.330	0,23
			101.813	4,31
STAATSEMISSIONEN				
Export-Import Bank of Korea				
2,125 % fällig am 18.01.2032		7.200	5.901	0,25
4,875 % fällig am 11.01.2026		200	198	0,01
5,125 % fällig am 11.01.2033		8.400	8.617	0,36
Korea Expressway Corp.				
1,125 % fällig am 17.05.2026		4.800	4.253	0,18
Korea Water Resources Corp.				
3,500 % fällig am 27.04.2025		6.500	6.267	0,27
			25.236	1,07
Summe Südkorea			127.049	5,38
SPANIEN				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Banco Santander S.A.				
5,147 % fällig am 18.08.2025		9.600	9.434	0,40

BESCHREIBUNG		PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
SRI LANKA				
STAATSEMISSIONEN				
Sri Lanka Government International Bond				
5,750 % fällig am 18.04.2023 ^	$	6.900	$ 3.147	0,13
5,875 % fällig am 25.07.2022 ^		1.236	575	0,02
6,125 % fällig am 03.06.2025 ^		3.700	1.765	0,08
6,200 % fällig am 11.05.2027 ^		4.100	1.888	0,08
6,750 % fällig am 18.04.2028 ^		6.800	3.131	0,13
6,825 % fällig am 18.07.2026 ^		3.800	1.800	0,08
6,850 % fällig am 14.03.2024 ^		900	414	0,02
6,850 % fällig am 03.11.2025 ^		3.000	1.430	0,06
7,550 % fällig am 28.03.2030 ^		16.800	7.735	0,33
7,850 % fällig am 14.03.2029 ^		1.600	737	0,03
Summe Sri Lanka			22.622	0,96
ÜBERNATIONAL				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
African Export-Import Bank				
2,634 % fällig am 17.05.2026		5.500	4.977	0,21
Asian Development Bank				
4,700 % fällig am 12.03.2024	MXN	89.800	4.951	0,21
6,550 % fällig am 26.01.2025	ZAR	118.000	5.985	0,25
Banque Ouest Africaine de Developpement				
2,750 % fällig am 22.01.2033	€	5.400	4.301	0,18
5,000 % fällig am 27.07.2027	$	800	733	0,03
Eastern & Southern African Trade & Development Bank				
4,125 % fällig am 30.06.2028		6.900	5.448	0,23
Internationale Bank für Wiederaufbau und Entwicklung				
5,310 % fällig am 05.02.2026	ZAR	114.000	5.564	0,24
International Finance Corp.				
8,000 % fällig am 09.10.2023	IDR	57.500.000	3.852	0,16
			35.811	1,51
STAATSEMISSIONEN				
Ghana Government International Bond				
10,750 % fällig am 14.10.2030 ^	$	200	135	0,01
Summe Supranational			35.946	1,52
SCHWEIZ				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Credit Suisse AG				
4,750 % fällig am 09.08.2024		4.100	4.008	0,17
UBS Group AG				
4,490 % fällig am 05.08.2025		4.200	4.107	0,17
6,373 % fällig am 15.07.2026		3.200	3.181	0,14
Summe Schweiz			11.296	0,48
TANSANIA				
KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG				
The Ministry of Finance and Planning, Government of the United Republic of Tanzania				
9,048 % fällig am 26.04.2028	€	5.273	5.673	0,24
TUNESIEN				
STAATSEMISSIONEN				
Banque Centrale de Tunisie Government International Bond				
5,625 % fällig am 17.02.2024		4.300	3.902	0,17
5,750 % fällig am 30.01.2025 (g)	$	1.400	937	0,04
6,375 % fällig am 15.07.2026	€	900	572	0,02
6,750 % fällig am 31.10.2023		1.201	1.220	0,05
Summe Tunesien			6.631	0,28

BESCHREIBUNG		PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
TÜRKEI				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Akbank T.A.S.				
6,800 % fällig am 22.06.2031 (d)	$	6.500	$ 5.942	0,25
Turkish Airlines Pass-Through Trust				
4,200 % fällig am 15.09.2028		200	184	0,01
			6.126	0,26
STAATSEMISSIONEN				
Export-Credit Bank of Turkey				
5,750 % fällig am 06.07.2026		11.000	9.965	0,42
8,250 % fällig am 24.01.2024		900	899	0,04
Turkey Government International Bond				
4,875 % fällig am 16.04.2043		8.200	5.284	0,22
5,125 % fällig am 17.02.2028		2.500	2.180	0,09
5,750 % fällig am 11.05.2047		23.700	16.254	0,69
5,875 % fällig am 26.06.2031		2.400	2.006	0,09
5,950 % fällig am 15.01.2031		900	761	0,03
6,000 % fällig am 14.01.2041		0	0	0,00
6,875 % fällig am 17.03.2036		0	0	0,00
9,125 % fällig am 13.07.2030		5.300	5.267	0,22
			42.616	1,80
Summe Türkei			48.742	2,06
UKRAINE				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
NPC Ukrenergo				
6,875 % fällig am 09.11.2028 ^		8.100	1.741	0,08
STAATSEMISSIONEN				
State Agency of Roads of Ukraine				
6,250 % fällig am 24.06.2030 ^	$	7.900	1.722	0,07
Ukraine Government International Bond				
4,375 % fällig am 27.01.2032 ^	€	2.700	644	0,03
6,876 % fällig am 21.05.2031 ^	$	8.300	1.916	0,08
7,253 % fällig am 15.03.2035 ^		23.400	5.453	0,23
7,375 % fällig am 25.09.2034 ^		5.900	1.385	0,06
7,750 % fällig am 01.09.2024 ^		3.900	979	0,04
7,750 % fällig am 01.09.2025 ^		6.800	1.736	0,07
7,750 % fällig am 01.09.2026 ^		12.300	2.996	0,13
7,750 % fällig am 01.09.2027 ^		9.000	2.172	0,09
7,750 % fällig am 01.09.2028 ^		100	24	0,00
8,994 % fällig am 01.02.2026 ^		4.300	1.088	0,05
			20.115	0,85
Summe Ukraine			21.856	0,93
VEREINIGTE ARABISCHE EMIRATE				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
First Abu Dhabi Bank PJSC				
4,774 % fällig am 06.06.2028		6.500	6.447	0,27
MDGH GMTN RSC Ltd.				
3,700 % fällig am 07.11.2049		3.000	2.392	0,10
3,950 % fällig am 21.05.2050		800	667	0,03
5,084 % fällig am 22.05.2053		2.000	1.993	0,09
Sweihan PV Power Co. PJSC				
3,625 % fällig am 31.01.2049		4.965	4.019	0,17
			15.518	0,66
KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG				
NMC OpCo Ltd.				
11,255 % fällig am 25.03.2027	AED	25.528	7.019	0,30
STAATSEMISSIONEN				
Emirate of Abu Dhabi Government International Bond				
3,125 % fällig am 30.09.2049	$	800	588	0,02
3,875 % fällig am 16.04.2050		4.600	3.879	0,16
Emirate of Dubai Government International Bond				
3,900 % fällig am 09.09.2050		700	508	0,02
Finanzministerium der Regierung von Schardscha				
4,000 % fällig am 28.07.2050		4.800	3.084	0,13
4,375 % fällig am 10.03.2051		3.000	2.061	0,09
6,500 % fällig am 23.11.2032		12.300	12.719	0,54
			22.839	0,96
Summe Vereinigte Arabische Emirate			45.376	1,92
GROSSBRITANNIEN				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Barclays PLC				
5,304 % fällig am 09.08.2026	$	6.000	$ 5.855	0,25
5,746 % fällig am 09.08.2033		1.000	968	0,04
HSBC Holdings PLC				
3,803 % fällig am 11.03.2025		300	294	0,01
5,210 % fällig am 11.08.2028		2.500	2.447	0,10
Lloyds Banking Group PLC				
4,716 % fällig am 11.08.2026		2.600	2.527	0,11
NatWest Group PLC				
4,269 % fällig am 22.03.2025		200	197	0,01
5,076 % fällig am 27.01.2030		300	286	0,01
Ukraine Railways Via Rail Capital Markets PLC				
7,875 % fällig am 15.07.2028 ^		6.500	2.490	0,11
8,250 % fällig am 09.07.2026 ^		3.100	1.194	0,05
Ukreximbank Via Biz Finance PLC				
9,750 % fällig am 22.01.2025		650	569	0,02
			16.827	0,71
NON-AGENCY-MBS				
Canada Square Funding PLC				
5,316 % fällig am 17.01.2059	£	2.016	2.548	0,11
Polaris PLC				
6,141 % fällig am 23.05.2059		5.080	6.471	0,27
6,154 % fällig am 27.05.2057		322	409	0,02
Rochester Financing PLC				
5,602 % fällig am 18.12.2044		2.033	2.554	0,11
Stratton Mortgage Funding PLC				
5,765 % fällig am 12.03.2052		515	653	0,03
Towd Point Mortgage Funding PLC				
6,097 % fällig am 20.05.2045		853	1.082	0,04
6,546 % fällig am 20.02.2054		2.079	2.644	0,11
Tower Bridge Funding PLC				
5,629 % fällig am 20.12.2063		1.476	1.867	0,08
			18.228	0,77
Summe Großbritannien			35.055	1,48
USA				
FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE				
Countrywide Asset-Backed Certificates Trust				
5,630 % fällig am 25.02.2037	$	700	673	0,03
6,275 % fällig am 25.11.2035		639	622	0,03
Credit-Based Asset Servicing & Securitization Trust				
3,156 % fällig am 25.01.2037 ^		2.325	728	0,03
Long Beach Mortgage Loan Trust				
5,450 % fällig am 25.09.2036		801	510	0,02
MASTR Asset-Backed Securities Trust				
5,590 % fällig am 25.11.2036		888	529	0,02
Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust				
5,945 % fällig am 25.03.2034		739	713	0,03
Nomura Home Equity Loan, Inc. Home Equity Loan Trust				
5,300 % fällig am 25.07.2036		172	155	0,01
Option One Mortgage Loan Trust				
5,370 % fällig am 25.05.2037		230	136	0,01
Park Place Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates				
5,930 % fällig am 25.09.2035		1.000	841	0,04
Saxon Asset Securities Trust				
5,460 % fällig am 25.09.2037		44	41	0,00
Soundview Home Loan Trust				
5,330 % fällig am 25.02.2037		194	56	0,00
6,050 % fällig am 25.10.2037		124	97	0,00
			5.101	0,22
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Alphabet, Inc.				
2,250 % fällig am 15.08.2060	$	4.100	2.497	0,10
Bank of America Corp.				
0,981 % fällig am 25.09.2025		8.700	8.177	0,35
Credit Suisse AG AT1 Claim ^		2.100	84	0,00
Ford Motor Co.				
3,250 % fällig am 12.02.2032		12.000	9.451	0,40
JPMorgan Chase & Co.				
0,653 % fällig am 16.09.2024	$	2.600	$ 2.570	0,11
Morgan Stanley				
0,864 % fällig am 21.10.2025		2.500	2.326	0,10
Pricoa Global Funding				
4,200 % fällig am 28.08.2025		450	436	0,02
Rutas 2 and 7 Finance Ltd.				
0,000 % fällig am 30.09.2036 (b)		4.680	3.069	0,13
Santander Holdings USA, Inc.				
5,807 % fällig am 09.09.2026		12.000	11.792	0,50
			40.402	1,71
NON-AGENCY-MBS				
Banc of America Merrill Lynch Commercial Mortgage, Inc.				
4,407 % fällig am 15.11.2061		3.300	3.137	0,13
Benchmark Mortgage Trust				
4,261 % fällig am 10.10.2051		4.400	4.065	0,17
CitiMortgage Alternative Loan Trust				
5,800 % fällig am 25.10.2036		75	63	0,00
Countrywide Alternative Loan Trust				
5,500 % fällig am 25.05.2036 ^		118	48	0,00
Credit Suisse Mortgage Capital Certificates				
3,519 % fällig am 30.11.2037		586	538	0,02
IndyMac Mortgage Loan Trust				
3,062 % fällig am 25.11.2037		204	167	0,01
5,510 % fällig am 25.02.2037		255	246	0,01
5,790 % fällig am 25.07.2045		56	44	0,00
JPMorgan Resecuritization Trust				
2,500 % fällig am 25.03.2056		32	30	0,00
Lehman XS Trust				
5,530 % fällig am 25.09.2046		210	180	0,01
5,650 % fällig am 25.08.2037		747	682	0,03
Structured Asset Mortgage Investments Trust				
5,300 % fällig am 25.02.2037		397	358	0,02
SunTrust Adjustable Rate Mortgage Loan Trust				
3,732 % fällig am 25.10.2037 ^		61	54	0,00
WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust				
3,883 % fällig am 25.03.2036		192	175	0,01
			9.787	0,41
US-REGIERUNGSBEHÖRDEN				
Uniform Mortgage-Backed Security, TBA				
2,500 % fällig am 01.07.2053		1.300	1.103	0,05
3,500 % fällig am 01.08.2053		2.600	2.372	0,10
			3.475	0,15
US-SCHATZOBLIGATIONEN				
U.S. Treasury Bonds				
2,375 % fällig am 15.02.2042 (g)		8.600	6.700	0,28
3,250 % fällig am 15.05.2042		66.400	59.285	2,51
3,375 % fällig am 15.08.2042		25.500	23.158	0,98
U.S. Treasury Notes				
3,125 % fällig am 31.08.2029		37.800	35.910	1,52
			125.053	5,29
Summe USA			183.818	7,78
URUGUAY				
STAATSEMISSIONEN				
Uruguay Government International Bond				
4,975 % fällig am 20.04.2055		14.600	14.243	0,60
5,100 % fällig am 18.06.2050		14.418	14.403	0,61
5,750 % fällig am 28.10.2034		11.200	12.120	0,52
7,625 % fällig am 21.03.2036		0	0	0,00
7,875 % fällig am 15.01.2033		0	0	0,00
Summe Uruguay			40.766	1,73
VIETNAM				
STAATSEMISSIONEN				
Vietnam Government International Bond				
4,800 % fällig am 19.11.2024		1.000	984	0,04

BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
JUNGFERNINSELN (BRITISCH)			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Star Energy Geothermal Wayang Windu Ltd.			
6,750 % fällig am 24.04.2033	$ 6.243	$ 6.135	0,26
SAMBIA			
STAATSEMISSIONEN			
Zambia Government International Bond			
5,375 % fällig am 20.09.2022 ^	1.200	633	0,03
8,500 % fällig am 14.04.2024 ^	4.400	2.568	0,11
Summe Sambia		3.201	0,14

BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
KURZFRISTIGE INSTRUMENTE			
COMMERCIAL PAPER			
Electricite de France S.A.			
5,510 % fällig am 03.08.2023	$ 2.600	$ 2.586	0,11
5,510 % fällig am 04.08.2023	2.650	2.635	0,11
Humana, Inc.			
5,510 % fällig am 02.08.2023	250	249	0,01
5,510 % fällig am 03.08.2023	300	298	0,01

BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
Mondelez International, Inc.			
5,370 % fällig am 24.07.2023	$ 900	$ 897	0,04
5,370 % fällig am 25.07.2023	350	349	0,02
5,400 % fällig am 19.07.2023	750	748	0,03
5,430 % fällig am 13.07.2023	2.600	2.595	0,11
5,430 % fällig am 14.07.2023	4.000	3.992	0,17
Summe kurzfristige Instrumente		14.349	0,61
Summe Übertragbare Wertpapiere		**$ 2.242.384**	**94,92**

PENSIONSGESCHÄFTE

Kontrahent	Kredit-zins	Abrechnungs-datum	Fälligkeits-datum	Kapital-betrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensions-geschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensions-geschäft[1]	% des Nettovermögens
BPS	5,120 %	30.06.2023	03.07.2023 $	84.900	U.S. Treasury Notes 2,500 % fällig am 30.04.2024	$ (86.590)	$ 84.900	$ 84.936	3,59
FICC	2,400	30.06.2023	03.07.2023	6.040	U.S. Treasury Notes 4,625 % fällig am 30.06.2025	(6.161)	6.040	6.040	0,26
Summe Pensionsgeschäfte						**$ (92.751)**	**$ 90.940**	**$ 90.976**	**3,85**

[1] Umfasst aufgelaufene Zinsen.

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

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

FUTURES

Beschreibung	Art	Ablauf-monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Euro-Bobl September Futures	Short	09.2023	418	$ 805	0,03
Euro-Bund 10-Year Bond September Futures	Short	09.2023	411	573	0,02
Euro-Buxl 30-Year Bond September Futures	Short	09.2023	17	(38)	0,00
Euro-Schatz September Futures	Long	09.2023	426	(408)	(0,02)
U.S. Treasury 2-Year Note September Futures	Long	09.2023	348	(603)	(0,02)
U.S. Treasury 5-Year Note September Futures	Short	09.2023	665	1.198	0,05
U.S. Treasury 10-Year Note September Futures	Long	09.2023	3.134	(5.364)	(0,23)
U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond September Futures	Long	09.2023	119	195	0,01
				$ (3.642)	(0,16)
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate				**$ (3.642)**	**(0,16)**

ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)

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

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMMISSIONEN - SCHUTZVERKAUF[1]

Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag[2]	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
AT&T, Inc.	1,000 %	20.06.2024	$ 300	$ 1	0,00

ZINSSWAPS

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Zahlung	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	5,585 %	28.06.2026	£ 13.300	$ (26)	0,00
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	0,000	15.09.2023	$ 1.800	25	0,00
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,000	21.09.2024	63.400	2.253	0,11
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,750	15.06.2024	68.300	(283)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,750	15.12.2031	1.800	(308)	(0,01)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,415	04.01.2027	BRL 78.000	356	0,01
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,453	04.01.2027	44.100	209	0,01
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,620	04.01.2027	17.700	100	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,828	02.01.2025	68.400	46	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	12,220	02.01.2025	160.300	117	0,01
Erhalt	1-Year BRL-CDI	13,015	04.01.2027	81.200	(1.062)	(0,05)
Erhalt	1-Year BRL-CDI	13,190	02.01.2025	28.100	(151)	(0,01)
Erhalt	1-Year BRL-CDI	13,215	02.01.2025	28.200	(153)	(0,01)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	13,400	02.01.2025	66.100	(401)	0,00

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Zahlung	1-Year BRL-CDI	13,400 %	02.01.2025	BRL 93.200	$ 568	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	0,000	15.09.2023	$ 1.800	(25)	0,00
Erhalt	3-Month ZAR-JIBAR	5,950	30.11.2024	ZAR 346.600	677	0,03
Zahlung	6-Month CZK-PRIBOR	4,611	06.06.2028	CZK 639.600	(157)	(0,01)
Erhalt[3]	6-Month EUR-EURIBOR	3,000	20.09.2033	€ 12.500	(111)	0,00
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR	5,455	10.01.2028	PLN 18.000	(37)	0,00
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR	5,490	10.01.2028	17.100	(41)	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	8,585	18.05.2028	MXN 34.400	(17)	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	8,740	07.03.2028	110.800	75	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	8,760	19.05.2028	1.600	(1)	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	8,900	21.05.2027	120.600	(67)	0,00
					$ 1.586	0,07
Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate					**$ 1.587**	**0,07**

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

(2) Der maximal mögliche Betrag, den der Fonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

(3) Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft.

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

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

VERKAUFSOPTIONEN

ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag[1]	Aufgeld	Markt-wert	% des Nettovermögens
BOA	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,380 %	31.07.2023	4.100	$ (16)	$ (19)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,780	31.07.2023	4.100	(16)	(12)	0,00
BRC	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,260	26.07.2023	2.600	(8)	(5)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,660	26.07.2023	2.600	(8)	(13)	0,00
	Call - OTC 7-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,350	27.07.2023	1.900	(4)	(4)	0,00
	Put - OTC 7-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,850	27.07.2023	1.900	(4)	(7)	0,00
GLM	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,260	26.07.2023	2.100	(7)	(4)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,660	26.07.2023	2.100	(7)	(10)	0,00
	Call - OTC 7-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,350	27.07.2023	1.900	(5)	(4)	0,00
	Put - OTC 7-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,850	27.07.2023	1.900	(5)	(7)	0,00
MYC	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,270	24.07.2023	3.600	(12)	(6)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,670	24.07.2023	3.600	(12)	(15)	0,00
							$ (104)	$ (106)	0,00

(1) Der Nennbetrag stellt die Anzahl der Kontrakte dar.

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMMISSIONEN - SCHUTZKAUF[1]

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu bezahlender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag[3]	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Markt-wert	% des Nettovermögens
BOA	Oman Government International Bond	(1,000) %	20.12.2027	$ 2.200	$ 72	$ (42)	$ 30	0,00
	Turkey Government International Bond	(1,000)	20.12.2026	4.300	715	(260)	455	0,02
BPS	Oman Government International Bond	(1,000)	20.12.2027	700	23	(13)	10	0,00
BRC	Oman Government International Bond	(1,000)	20.12.2027	3.400	91	(45)	46	0,00
CBK	China Government International Bond	(1,000)	20.06.2024	15.000	(167)	51	(116)	0,00
	Turkey Government International Bond	(1,000)	20.12.2026	2.800	467	(170)	297	0,01
GST	China Government International Bond	(1,000)	20.06.2024	15.000	(167)	51	(116)	0,00
	South Korea Government International Bond	(1,000)	20.06.2028	43.200	(1.141)	(170)	(1.311)	(0,06)
MYC	Turkey Government International Bond	(1,000)	20.12.2026	2.500	423	(158)	265	0,01
					$ 316	$ (756)	$ (440)	(0,02)

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMMISSIONEN - SCHUTZVERKAUF[2]

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag[3]	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Markt-wert	% des Nettovermögens
BOA	Brazil Government International Bond	1,000 %	20.06.2031	$ 1.200	$ (181)	$ 63	$ (118)	(0,01)
	Chile Government International Bond	1,000	20.06.2024	200	1	1	2	0,00
	Mexico Government International Bond	1,000	20.12.2024	18.100	13	179	192	0,01
	Peru Government International Bond	1,000	20.06.2026	6.400	26	86	112	0,01
	Peru Government International Bond	1,000	20.12.2031	11.900	(502)	267	(235)	(0,01)
	South Africa Government International Bond	1,000	20.06.2024	9.400	(90)	91	1	0,00

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag[3]	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Markt-wert	% des Nettovermögens
	South Africa Government International Bond	1,000 %	20.12.2025	$ 1.200	$ (66)	$ 46	$ (20)	0,00
	Turkey Government International Bond	1,000	20.06.2027	100	(20)	8	(12)	0,00
BPS	Brazil Government International Bond	1,000	20.12.2026	10.400	(639)	605	(34)	0,00
	Brazil Government International Bond	1,000	20.12.2027	8.200	(589)	409	(180)	(0,01)
	Chile Government International Bond	1,000	20.12.2023	900	2	2	4	0,00
	Chile Government International Bond	1,000	20.06.2024	3.300	9	20	29	0,00
	Chile Government International Bond	1,000	20.12.2024	4.000	5	44	49	0,00
	Colombia Government International Bond	1,000	20.12.2023	4.200	(2)	15	13	0,00
	Mexico Government International Bond	1,000	20.12.2023	500	0	2	2	0,00
	Mexico Government International Bond	1,000	20.12.2024	2.100	(5)	27	22	0,00
	Peru Government International Bond	1,000	20.06.2026	6.100	54	53	107	0,01
	Poland Government International Bond	1,000	20.12.2023	700	2	1	3	0,00
	Romania Government International Bond	1,000	20.12.2023	1.400	(6)	10	4	0,00
	Serbia Government International Bond	1,000	20.12.2027	1.600	(142)	70	(72)	0,00
	South Africa Government International Bond	1,000	20.06.2028	32.000	(2.760)	522	(2.238)	(0,09)
	Turkey Government International Bond	1,000	20.06.2027	3.800	(751)	292	(459)	(0,02)
BRC	Argentina Government International Bond	5,000	20.12.2023	800	(96)	37	(59)	0,00
	Brazil Government International Bond	1,000	20.12.2030	1.400	(194)	68	(126)	(0,01)
	Chile Government International Bond	1,000	20.06.2024	5.800	18	33	51	0,00
	Chile Government International Bond	1,000	20.12.2026	2.500	14	31	45	0,00
	Hungary Government International Bond	1,000	20.12.2023	4.000	(29)	40	11	0,00
	Peru Government International Bond	1,000	20.12.2025	17.500	360	(77)	283	0,01
	Poland Government International Bond	1,000	20.06.2028	6.500	49	24	73	0,00
	Romania Government International Bond	1,000	20.12.2023	800	(6)	9	3	0,00
CBK	Colombia Government International Bond	1,000	20.12.2023	4.200	(1)	14	13	0,00
	Colombia Government International Bond	1,000	20.06.2024	300	(3)	4	1	0,00
	Colombia Government International Bond	1,000	20.12.2024	800	3	(1)	2	0,00
	Panama Government International Bond	1,000	20.06.2024	2.300	4	12	16	0,00
	Panama Government International Bond	1,000	20.12.2024	4.300	0	39	39	0,00
	Peru Government International Bond	1,000	20.06.2026	2.100	18	19	37	0,00
	Qatar Government International Bond	1,000	20.12.2026	5.000	140	(17)	123	0,01
DUB	South Africa Government International Bond	1,000	20.06.2024	13.800	(148)	150	2	0,00
	South Africa Government International Bond	1,000	20.12.2026	10.400	(638)	271	(367)	(0,01)
GLM	Romania Government International Bond	1,000	20.12.2023	600	(2)	4	2	0,00
GST	Brazil Government International Bond	1,000	20.06.2026	200	(11)	12	1	0,00
	Brazil Government International Bond	1,000	20.06.2031	1.500	(227)	80	(147)	(0,01)
	Chile Government International Bond	1,000	20.06.2028	9.500	18	101	119	0,01
	Colombia Government International Bond	1,000	20.12.2024	14.000	(34)	74	40	0,00
	Indonesia Government International Bond	1,000	20.06.2028	10.100	37	29	66	0,00
	Mexico Government International Bond	1,000	20.12.2023	900	1	3	4	0,00
	Peru Government International Bond	1,000	20.06.2026	13.700	98	141	239	0,01
	Poland Government International Bond	1,000	20.12.2023	1.500	5	1	6	0,00
	Poland Government International Bond	1,000	20.06.2024	11.200	50	33	83	0,00
	Poland Government International Bond	1,000	20.06.2028	8.500	77	19	96	0,00
	South Africa Government International Bond	1,000	20.06.2024	1.000	(10)	10	0	0,00
	Turkey Government International Bond	1,000	20.06.2027	4.300	(840)	321	(519)	(0,02)
HUS	Mexico Government International Bond	1,000	20.06.2024	100	(1)	2	1	0,00
JPM	Banco do Brasil S.A.	1,000	20.12.2024	8.000	(179)	114	(65)	0,00
	Hungary Government International Bond	1,000	20.06.2027	5.700	(290)	212	(78)	0,00
	Indonesia Government International Bond	1,000	20.12.2024	7.400	60	16	76	0,00
	Poland Government International Bond	1,000	20.06.2028	900	(2)	12	10	0,00
	South Africa Government International Bond	1,000	20.12.2023	2.500	(40)	44	4	0,00
MYC	Argentina Government International Bond	5,000	20.12.2023	1.500	(289)	178	(111)	0,00
	Brazil Government International Bond	1,000	20.06.2027	2.800	(173)	143	(30)	0,00
	Brazil Government International Bond	1,000	20.12.2030	2.900	(405)	144	(261)	(0,01)
	Chile Government International Bond	1,000	20.12.2024	2.400	6	24	30	0,00
	Chile Government International Bond	1,000	20.06.2026	15.000	208	64	272	0,01
	Chile Government International Bond	1,000	20.12.2026	16.300	112	179	291	0,01
	Colombia Government International Bond	1,000	20.12.2023	3.800	0	12	12	0,00
	Mexico Government International Bond	1,000	20.12.2024	4.800	19	32	51	0,00
	Mexico Government International Bond	1,000	20.06.2028	200	(5)	5	0	0,00
	Peru Government International Bond	1,000	20.06.2026	9.800	45	127	172	0,01
	Peru Government International Bond	1,000	20.12.2026	20.000	80	261	341	0,02
	South Africa Government International Bond	1,000	20.12.2026	4.600	(206)	43	(163)	(0,01)
	Turkey Government International Bond	1,000	20.06.2027	1.800	(356)	139	(217)	(0,01)
MYI	Peru Government International Bond	1,000	20.06.2026	1.300	11	12	23	0,00
					$ (8.393)	$ 6.060	$ (2.333)	(0,10)

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

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

(3) Der maximal mögliche Betrag, den der Fonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung		Zu erhaltende Währung		Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2023	€	905	$	989	$ 2	$ 0	$ 2	0,00
	07.2023	ILS	34.300		9.926	677	0	677	0,03
	07.2023	¥	700		5	0	0	0	0,00
	07.2023	PLN	393		94	0	(3)	(3)	0,00
	07.2023	$	7.163	€	6.665	109	0	109	0,00
	07.2023		2.337	£	1.848	12	0	12	0,00
	07.2023		29	PLN	122	1	0	1	0,00
BPS	07.2023	€	336	$	366	0	0	0	0,00
	07.2023	$	228.990	€	208.990	0	(982)	(982)	(0,04)
	07.2023		11.951	¥	1.661.103	0	(458)	(458)	(0,02)
	07.2023		18	MYR	84	0	0	0	0,00
	08.2023	€	208.990	$	229.312	992	0	992	0,04
	08.2023	MYR	75.495		16.251	28	0	28	0,00
	08.2023	$	8	CNY	53	0	0	0	0,00
	08.2023	ZAR	189.371	$	10.176	192	0	192	0,01
	09.2023	$	3.045	INR	250.285	0	(2)	(2)	0,00
	11.2023	ILS	25.816	$	7.485	482	0	482	0,02
BRC	07.2023	$	15	MYR	70	0	0	0	0,00
	08.2023	COP	38.490.507	$	9.035	0	(69)	(69)	0,00
	08.2023	ZAR	350.461		18.705	317	(86)	231	0,01
	09.2023	$	61	ILS	218	0	(2)	(2)	0,00
	09.2023	ZAR	253.669	$	14.363	1.028	0	1.028	0,04
	10.2023	MXN	202.568		10.811	0	(772)	(772)	(0,03)
CBK	07.2023	CZK	5.142		234	0	(2)	(2)	0,00
	07.2023	€	15.747		16.966	1	(215)	(214)	(0,01)
	07.2023	ILS	183.353		56.947	7.535	0	7.535	0,32
	07.2023	$	1.348	€	1.232	0	(4)	(4)	0,00
	08.2023	COP	19.735.373	$	4.667	0	(1)	(1)	0,00
	08.2023	ILS	133.218		41.282	5.358	0	5.358	0,23
	11.2023		116.445		34.322	2.735	0	2.735	0,12
	11.2023	$	1.610	EGP	51.961	0	(111)	(111)	(0,01)
DUB	07.2023	ILS	24.133	$	6.892	385	0	385	0,02
	10.2023	ZAR	152.660		8.383	386	0	386	0,02
	11.2023	EGP	146.354		5.151	930	0	930	0,04
GLM	07.2023	BRL	68.480		14.182	0	(13)	(13)	0,00
	07.2023	DOP	659.238		11.385	0	(415)	(415)	(0,02)
	07.2023	$	12.767	BRL	68.263	1.383	0	1.383	0,06
	07.2023		72	PLN	304	3	0	3	0,00
	08.2023	DOP	372.278	$	6.612	26	(77)	(51)	0,00
	09.2023	$	14.182	BRL	69.239	11	0	11	0,00
	10.2023	DOP	216.683	$	3.865	24	0	24	0,00
	11.2023		158.353		2.848	62	0	62	0,00
	11.2023	EGP	25.380		900	168	0	168	0,01
	11.2023	$	5.231	EGP	158.950	0	(646)	(646)	(0,03)
	12.2023	DOP	128.789	$	2.313	54	0	54	0,00
JPM	07.2023	£	122		154	0	(1)	(1)	0,00
	07.2023	¥	565.444		3.954	42	0	42	0,00
	08.2023	COP	11.592.523		2.734	0	(19)	(19)	0,00
	08.2023	MXN	222.130		12.821	0	(27)	(27)	0,00
	08.2023	$	8	CNY	56	0	0	0	0,00
	08.2023		154	£	122	1	0	1	0,00
	08.2023		3.954	¥	563.041	0	(42)	(42)	0,00
	09.2023	COP	7.349.683	$	1.728	4	0	4	0,00
	09.2023	PEN	1.851		503	0	(5)	(5)	0,00
	09.2023	$	59	ILS	209	0	(2)	(2)	0,00
	10.2023	MXN	94.231	$	5.367	0	(22)	(22)	0,00
MBC	07.2023	€	1.618		1.735	0	(30)	(30)	0,00
	07.2023	£	18.528		22.935	0	(621)	(621)	(0,03)
	07.2023	$	38.868	ILS	141.185	0	(808)	(808)	(0,03)
	08.2023		234	ZAR	4.333	0	(5)	(5)	0,00
	09.2023		8.698	INR	715.169	0	(5)	(5)	0,00
	11.2023		41.667	ILS	150.231	0	(916)	(916)	(0,04)
MYI	07.2023	€	7.215	$	7.857	0	(15)	(15)	0,00
	07.2023	£	20		25	0	0	0	0,00
	07.2023	$	114	CZK	2.521	1	0	1	0,00
	07.2023		239	€	219	0	0	0	0,00
	07.2023		1.860	£	1.474	14	0	14	0,00
	08.2023		1.621	ZAR	29.663	0	(57)	(57)	0,00
	09.2023	AED	26.160	$	7.122	0	0	0	0,00
	11.2023	EGP	40.209		1.425	265	0	265	0,01
RBC	07.2023	$	20	MXN	394	2	0	2	0,00
	08.2023		12.997		225.246	30	0	30	0,00
SCX	07.2023		74	£	59	1	0	1	0,00
	07.2023		19	MYR	85	0	0	0	0,00
	08.2023	CNH	349	$	51	3	0	3	0,00
	08.2023	$	50	CNH	343	0	(3)	(3)	0,00
	08.2023		36.697	ILS	133.218	0	(772)	(772)	(0,03)
SOG	07.2023	€	195.421	$	210.222	0	(2.982)	(2.982)	(0,13)
	07.2023	PLN	1.598		371	0	(22)	(22)	0,00
SSB	09.2023	BRL	61.602		12.151	0	(477)	(477)	(0,02)
TOR	07.2023	$	21.195	£	16.680	11	0	11	0,00

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung		Zu erhaltende Währung		Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
	08.2023	£	16.680	$	21.200	$ 0	$ (10)	$ (10)	0,00
UAG	07.2023	€	2.860		3.060	0	(60)	(60)	0,00
	07.2023	$	28.664	ILS	100.600	0	(1.555)	(1.555)	(0,07)
	08.2023	ZAR	1.355	$	71	0	(1)	(1)	0,00
	09.2023	$	51	ILS	181	0	(2)	(2)	0,00
	09.2023	ZAR	83.188	$	4.745	372	0	372	0,01
	10.2023		49.197		2.657	80	0	80	0,00
	11.2023	ILS	7.970		2.305	143	0	143	0,01
						$ 23.870	$ (12.317)	$ 11.553	0,49

ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklasse Institutional CHF (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung		Zu erhaltende Währung		Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2023	$	406	CHF	363	$ 0	$ 0	$ 0	0,00
BPS	07.2023	CHF	17.412	$	19.469	7	0	7	0,00
	07.2023	$	27.869	CHF	25.218	319	0	319	0,01
	08.2023		19.469		17.362	0	(7)	(7)	0,00
MBC	07.2023	CHF	2	$	2	0	0	0	0,00
MYI	07.2023		487		538	0	(6)	(6)	0,00
SCX	07.2023	$	32.107	CHF	28.961	264	0	264	0,01
						$ 590	$ (13)	$ 577	0,02

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklassen Institutional EUR (Hedged) thesaurierend, Institutional EUR (Hedged) ausschüttend und Class E EUR (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung		Zu erhaltende Währung		Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2023	€	1.058	$	1.149	$ 1	$ (6)	$ (5)	0,00
	07.2023	$	396.548	€	368.983	6.014	0	6.014	0,25
BPS	07.2023	€	382.136	$	418.682	1.774	(2)	1.772	0,08
	07.2023	$	396.560	€	368.873	5.887	(7)	5.880	0,25
	08.2023		412.433		375.883	0	(1.785)	(1.785)	(0,08)
CBK	07.2023	€	370.707	$	402.816	1	(1.627)	(1.626)	(0,07)
	07.2023	$	11.375	€	10.549	135	(1)	134	0,01
	08.2023		385.865		354.416	1.333	0	1.333	0,06
JPM	07.2023	€	375.492	$	410.000	338	0	338	0,01
	07.2023	$	25.373	€	23.731	518	0	518	0,02
	08.2023		410.573		375.492	0	(350)	(350)	(0,01)
MBC	07.2023	€	38.829	$	41.694	6	(674)	(668)	(0,03)
	07.2023	$	29.612	€	27.391	271	0	271	0,01
SOG	07.2023		396.021		368.139	5.618	0	5.618	0,24
						$ 21.896	$ (4.452)	$ 17.444	0,74

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklasse Institutional GBP (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung		Zu erhaltende Währung		Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2023	£	13	$	17	$ 0	$ 0	$ 0	0,00
	07.2023	$	263	£	208	2	0	2	0,00
BPS	07.2023		46.039		37.219	1.281	(1)	1.280	0,06
BRC	07.2023	£	27	$	34	0	0	0	0,00
	07.2023	$	104	£	82	0	0	0	0,00
CBK	07.2023	£	940	$	1.191	0	(4)	(4)	0,00
	07.2023	$	458	£	362	2	0	2	0,00
MBC	07.2023		45.908		37.082	1.237	0	1.237	0,05
MYI	07.2023	£	18	$	23	0	(1)	(1)	0,00
	07.2023	$	45.592	£	36.683	1.045	0	1.045	0,04
						$ 3.567	$ (6)	$ 3.561	0,15

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklasse Investor NOK (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung		Zu erhaltende Währung		Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2023	$	183	NOK	2.022	$ 5	$ 0	$ 5	0,00
BPS	07.2023	NOK	1.399	$	130	0	0	0	0,00
	08.2023	$	130	NOK	1.397	0	0	0	0,00
CBK	07.2023	NOK	75	$	7	0	0	0	0,00
	07.2023	$	157	NOK	1.762	8	0	8	0,00
GLM	07.2023	NOK	1.479	$	137	0	(1)	(1)	0,00
	08.2023	$	137	NOK	1.478	1	0	1	0,00
UAG	07.2023		140		1.548	5	0	5	0,00
						$ 19	$ (1)	$ 18	0,00

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklassen Investor SEK (Hedged) thesaurierend und Administrative SEK (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung		Zu erhaltende Währung		Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2023	SEK	8.925	$	827	$ 1	$ 0	$ 1	0,00
	07.2023	$	8	SEK	84	0	0	0	0,00
	08.2023		789		8.509	0	(1)	(1)	0,00
BRC	07.2023		45		483	0	0	0	0,00
CBK	07.2023		566		6.178	6	0	6	0,00
GLM	07.2023	SEK	1.245	$	115	0	0	0	0,00
	07.2023	$	6	SEK	69	0	0	0	0,00
MBC	07.2023	SEK	13	$	1	0	0	0	0,00
	07.2023	$	530	SEK	5.712	0	(2)	(2)	0,00
MYI	07.2023	SEK	8.523	$	789	0	0	0	0,00
	07.2023	$	810	SEK	8.699	0	(5)	(5)	0,00
	08.2023		789		8.512	0	0	0	0,00
SCX	07.2023	SEK	205	$	19	0	0	0	0,00
	07.2023	$	529	SEK	5.723	1	0	1	0,00
						$ 8	$ (8)	$ 0	0,00
Summe Freiverkehrsfinanzderivate								**$ 30.274**	**1,28**

LEERVERKAUFTE WERTPAPIERE

BESCHREIBUNG		PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
US-REGIERUNGSBEHÖRDEN				
Uniform Mortgage-Backed Security, TBA				
2,500 % fällig am 01.07.2053 (e)	$	650	$ (551)	(0,02)
Summe Leerverkaufte Wertpapiere			**$ (551)**	**(0,02)**
EINLAGENZERTIFIKATE				
Banco Davivienda S.A.				
13,501 % fällig am 13.12.2024	COP	10.517.000	2.518	0,11
15,389 % fällig am 21.02.2024		3.593.000	873	0,04
BanColombia S.A.				
5,917 % fällig am 27.01.2024		16.789.000	3.870	0,16
13,320 % fällig am 08.06.2025		5.439.000	1.307	0,06
13,637 % fällig am 14.12.2024		14.365.000	3.460	0,15
16,137 % fällig am 01.09.2024		5.832.000	1.413	0,06
BBVA Colombia S.A.				
5,870 % fällig am 15.07.2024		12.069.000	2.715	0,11
14,540 % fällig am 13.01.2024		7.110.900	1.689	0,07
16,412 % fällig am 25.04.2024		258.000	60	0,00
Summe Einlagenzertifikate			**$ 17.905**	**0,76**
Summe Anlagen			**$ 2.378.897**	**100,70**
Sonstige Aktiva und Passiva			**$ (16.564)**	**(0,70)**
Nettovermögen			**$ 2.362.333**	**100,00**

ERLÄUTERUNGEN ZUR AUFSTELLUNG DES WERTPAPIERBESTANDS (Angaben in Tausend*):

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

^ Das Wertpapier ist in Verzug.

(a) Wertpapier per Emissionstermin.

(b) Nullkuponwertpapier.

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

(d) Bedingt wandelbares Wertpapier.

(e) Zum 30. Juni 2023 leerverkaufte Wertpapiere sind durch langfristige Portfolioanlagen in übertragbaren Wertpapieren und Geldmarktinstrumenten abgedeckt.

(f) Eingeschränkte Wertpapiere (31. Dezember 2022: 0,64 %):

Emittentenbeschreibung	Kupon	Fälligkeits-datum	Kauf-datum	Kosten	Markt-wert	% des Nettovermögens
Entwicklungsbank für das südliche Afrika	8,600 %	21.10.2024	07.10.2021	$ 17.010	$ 13.178	0,56

(g) Wertpapiere mit einem gesamten beizulegenden Zeitwert von 37.109 USD (31. Dezember 2022: 38.910 USD) und Barmittel in Höhe von 264 USD (31. Dezember 2022: 300 USD) wurden zum 30. Juni 2023 gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen als Sicherheit für Pensionsgeschäfte verpfändet.

Barmittel in Höhe von 280 USD (31. Dezember 2022: 807 USD) wurden zum 30. Juni 2023 gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte als Sicherheit geliefert.

Barmittel in Höhe von 15.395 USD (31. Dezember 2022: 18.655 USD) wurden zum 30. Juni 2023 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Barmittel in Höhe von 4.530 USD (31. Dezember 2022: 6.470 USD) wurden zum 30. Juni 2023 gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. als Sicherheit für Finanzderivate verpfändet.

Beizulegender Zeitwert[1]

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 30. Juni 2023 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie[2]	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	$ 0	$ 2.215.125	$ 27.259	$ 2.242.384
Pensionsgeschäfte	0	90.940	0	90.940
Einlagen bei Kreditinstituten	0	6.492	11.413	17.905
Finanzderivate[3]	932	27.287	0	28.219
Leerverkaufte Wertpapiere	0	(551)	0	(551)
Summen	**$ 932**	**$ 2.339.293**	**$ 38.672**	**$ 2.378.897**

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

Kategorie[2]	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	$ 0	$ 2.396.551	$ 25.705	$ 2.422.256
Pensionsgeschäfte	0	44.661	0	44.661
Einlagen bei Kreditinstituten	0	0	1.659	1.659
Finanzderivate[3]	5.273	27.624	(11)	32.886
Summen	**$ 5.273**	**$ 2.468.836**	**$ 27.353**	**$ 2.501.462**

(1) Weitere Informationen finden Sie in den Erläuterungen in Erläuterung 3.

(2) Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung des Wertpapierbestands.

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

Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2023:

Kontrahent	Kredit-zins	Abrechnungs-datum	Fälligkeits-datum	Kredit-betrag	Verbindlichkeiten aus umgekehrten Pensions-geschäften	% des Nettovermögens
BOS	5,190 %	30.06.2023	03.07.2023	$ (701)	$ (701)	(0,03)
BPS	3,650	10.05.2023	TBD[1]	€ (19.808)	(21.717)	(0,92)
BRC	4,800	05.05.2023	TBD[1]	$ (789)	(793)	(0,03)
MYI	3,900	05.05.2023	TBD[1]	(3.511)	(3.534)	(0,15)
	4,250	05.05.2023	TBD[1]	(1.518)	(1.528)	(0,06)
NOM	3,250	05.05.2023	TBD[1]	(2.171)	(2.188)	(0,09)
	5,050	05.05.2023	TBD[1]	(4.872)	(4.911)	(0,21)
SCX	3,580	10.05.2023	TBD[1]	€ (1.449)	(1.589)	(0,07)
Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte					**$ (36.961)**	**(1,56)**

(1) Umgekehrtes Pensionsgeschäft mit offener Laufzeit.

Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC-Finanzderivate und -Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2023 und 31. Dezember 2022:

	Zum 30. Jun. 2023			Zum 31. Dez. 2022		
Kontrahent	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-engagement[1]	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-engagement[1]
BOA	$ 7.190	$ (5.690)	$ 1.500	$ 5	$ 0	$ 5
BPS	4.978	(3.290)	1.688	(1.369)	2.060	691
BRC	714	(420)	294	(218)	320	102
CBK	15.561	(14.983)	578	22.572	(21.703)	869
DUB	1.336	(990)	346	(250)	270	20
FBF	k. A.	k. A.	k. A.	(5)	0	(5)
GLM	557	(440)	117	619	(580)	39
GST	(1.439)	1.460	21	(2.119)	2.110	(9)
HUS	1	0	1	1	0	1
JPM	382	(360)	22	(645)	680	35
MBC	(1.547)	1.240	(307)	5.068	(4.320)	748
MYC	631	(540)	91	(538)	760	222
MYI	1.264	(500)	764	23	0	23
RBC	32	0	32	(189)	0	(189)
SCX	(506)	420	(86)	9.690	(9.190)	500
SOG	2.614	(1.930)	684	(20)	0	(20)
SSB	(477)	620	143	k. A.	k. A.	k. A.
TOR	1	0	1	k. A.	k. A.	k. A.
UAG	(1.018)	790	(228)	(311)	270	(41)

(1) Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären.

Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung des Wertpapierbestands zum 30. Juni 2023:

	30. Jun. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	85,19	84,95
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	9,73	12,05
Sonstige übertragbare Wertpapiere	0,00	0,17
Pensionsgeschäfte	3,85	1,79
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	(0,16)	0,04
Zentral abgerechnete Finanzderivate	0,07	(0,02)
Freiverkehrsfinanzderivate	1,28	1,30
Leerverkaufte Wertpapiere	(0,02)	k. A.
Einlagenzertifikate	0,76	0,07
Umgekehrte Pensionsgeschäfte	(1,56)	(1,56)

Das Anlageportfolio des Fonds konzentriert sich zum 30. Juni 2023 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	30. Jun. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
Argentinien	2,30	1,90
Armenien	0,28	0,27
Bahamas	0,36	0,33
Bahrain	0,97	0,93
Benin	0,44	0,36
Bermuda	0,15	0,13
Brasilien	1,77	3,00
Bulgarien	0,25	k. A.
Cayman-Inseln	1,89	2,06
Chile	2,26	2,80
China	0,00	0,01
Kolumbien	2,71	2,57
Costa Rica	0,86	1,12
Zypern	0,27	0,24
Dominikanische Republik	4,41	2,95
Ecuador	1,59	2,19
Ägypten	1,75	2,28
El Salvador	0,73	0,48
Frankreich	k. A.	0,10
Gabun	0,06	k. A.
Georgien	0,39	0,39
Deutschland	k. A.	0,02
Ghana	1,32	1,16
Guernsey, Kanalinseln	0,12	0,12
Hongkong	1,96	1,28
Ungarn	3,39	2,09
Indien	1,38	1,69
Indonesien	2,86	2,63
International	0,22	k. A.
Irland	0,08	0,08
Israel	k. A.	2,24
Elfenbeinküste	0,95	1,27
Jamaika	0,16	0,17
Jersey, Kanalinseln	0,52	0,48
Jordanien	0,66	0,38
Kasachstan	1,19	1,46
Kenia	0,58	0,54
Luxemburg	0,28	0,36
Mazedonien	0,74	k. A.
Malaysia	1,23	0,13
Mauritius	0,40	0,85
Mexiko	2,98	2,31
Mongolei	0,31	0,65
Marokko	0,65	0,77
Multinational	0,02	0,02
Namibia	0,09	0,09
Niederlande	1,36	0,87
Oman	2,89	3,07
Panama	3,26	2,85
Paraguay	1,03	0,91
Peru	1,42	1,36
Philippinen	1,45	1,24
Polen	1,41	0,40
Katar	1,66	1,81
Rumänien	3,52	2,26
Russland	0,01	0,04
Senegal	0,42	0,41
Serbien	1,43	0,84
Singapur	0,45	0,43
Südafrika	2,87	3,59
Südkorea	5,38	4,60
Spanien	0,40	0,38
Sri Lanka	0,96	0,67
Supranational	1,52	1,81
Schweiz	0,48	0,58

Anlagen zum Marktwert	30. Jun. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
Tansania	0,24	0,24
Tunesien	0,28	0,34
Türkei	2,06	2,08
Ukraine	0,93	0,78
Vereinigte Arabische Emirate	1,92	1,00
Großbritannien	1,48	1,65
USA	7,78	7,06
Uruguay	1,73	1,65
Usbekistan	k. A.	0,03
Vietnam	0,04	0,04
Jungferninseln (Britisch)	0,26	0,73
Sambia	0,14	0,12
Kurzfristige Instrumente	0,61	8,43
Pensionsgeschäfte	3,85	1,79
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	(0,16)	0,04
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen — Schutzkauf	k. A.	0,00
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen — Schutzverkauf	0,00	0,00
Zinsswaps	0,07	(0,02)
Freiverkehrsfinanzderivate		
Verkaufsoptionen		
Zinsswapoptionen		0,00
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen — Schutzkauf	(0,02)	0,00
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen — Schutzverkauf	(0,10)	(0,18)
Volatilitätsswaps	k. A.	0,00
Devisenterminkontrakte	0,49	0,21
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	0,91	1,27
Leerverkaufte Wertpapiere	(0,02)	k. A.
Einlagenzertifikate	0,76	0,07
Sonstige Aktiva und Passiva	(0,70)	(0,35)
Nettovermögen	100,00	100,00

Aufstellung des Wertpapierbestands des Emerging Markets Corporate Bond Fund

BESCHREIBUNG		PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE				
KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG				
Ecopetrol S.A.				
TBD % fällig am 17.08.2024	$	1.000	$ 985	0,62
Elfenbeinküste				
7,985 % fällig am 19.03.2027	€	800	851	0,53
SOCAR Turkey Enerji A/S				
6,553 % fällig am 11.08.2026		1.000	1.058	0,66
			2.894	1,81
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
BANKEN UND FINANZEN				
Abu Dhabi Commercial Bank PJSC				
3,500 % fällig am 31.03.2027	$	700	663	0,41
AIA Group Ltd.				
3,600 % fällig am 09.04.2029		1.100	1.019	0,64
Alfa Bank AO Via Alfa Bond Issuance PLC				
5,950 % fällig am 15.04.2030 ^(g)		1.300	78	0,05
Banco BTG Pactual S.A.				
4,500 % fällig am 10.01.2025		200	193	0,12
Banco de Chile				
2,990 % fällig am 09.12.2031		1.400	1.197	0,75
Banco de Credito del Peru S.A.				
2,700 % fällig am 11.01.2025		1.300	1.243	0,78
Banco de Credito e Inversiones S.A.				
3,500 % fällig am 12.10.2027		400	370	0,23
Banco Inbursa S.A.				
4,375 % fällig am 11.04.2027		1.325	1.252	0,78
Banco Internacional del Peru SAA Interbank				
3,250 % fällig am 04.10.2026		1.000	931	0,58
Banco Mercantil del Norte S.A.				
6,625 % fällig am 24.01.2032 (e)(g)		250	193	0,12
Banco Santander Chile				
2,700 % fällig am 10.01.2025		1.200	1.148	0,72
Banco Santander Mexico S.A.				
5,375 % fällig am 17.04.2025		1.800	1.782	1,12
Bangkok Bank PCL				
3,733 % fällig am 25.09.2034 (g)		400	340	0,21
Bank Hapoalim B.M.				
3,255 % fällig am 21.01.2032 (g)		1.300	1.118	0,70
Bank Leumi Le-Israel B.M.				
7,129 % fällig am 18.07.2033 (g)		1.300	1.288	0,81
Bank Mandiri Persero Tbk PT				
2,000 % fällig am 19.04.2026		800	724	0,45
Bank Negara Indonesia Persero Tbk PT				
3,750 % fällig am 30.03.2026 (g)		800	741	0,46
BOC Aviation Ltd.				
1,750 % fällig am 21.01.2026		700	632	0,40
Cibanco S.A. Ibm				
4,962 % fällig am 18.07.2029		900	846	0,53
Country Garden Holdings Co. Ltd.				
3,125 % fällig am 22.10.2025		200	63	0,04
Credicorp Ltd.				
2,750 % fällig am 17.06.2025		500	473	0,30
Entwicklungsbank für das südliche Afrika				
8,600 % fällig am 21.10.2024 (h)	ZAR	22.300	1.160	0,73
Emaar Sukuk Ltd.				
3,875 % fällig am 17.09.2029	$	400	376	0,24
Fab Sukuk Co. Ltd.				
2,500 % fällig am 21.01.2025		325	311	0,19
3,875 % fällig am 22.01.2024		1.100	1.089	0,68
4,581 % fällig am 17.01.2028		400	398	0,25
First Abu Dhabi Bank PJSC				
5,125 % fällig am 13.10.2027		900	913	0,57
Gaci First Investment Co.				
5,125 % fällig am 14.02.2053		500	451	0,28
GLP Pte. Ltd.				
3,875 % fällig am 04.06.2025		200	139	0,09
4,500 % fällig am 17.05.2026 (e)		300	112	0,07
Hipotecaria Su Casita S.A. de C.V.				
9,620 % fällig am 28.06.2018 ^	MXN	34.709	0	0,00
Huarong Finance Co. Ltd.				
3,375 % fällig am 24.02.2030	$	200	152	0,10
IIRSA Norte Finance Ltd.				
8,750 % fällig am 30.05.2024	$	6	$ 6	0,00
Indian Railway Finance Corp. Ltd.				
3,570 % fällig am 21.01.2032		800	698	0,44
Interoceanica Finance Ltd.				
0,000 % fällig am 30.11.2025 (c)		28	26	0,02
Kaisa Group Holdings Ltd.				
9,375 % fällig am 30.06.2024 ^		300	20	0,01
9,750 % fällig am 28.09.2023 ^		1.400	94	0,06
Kasikornbank PCL				
3,343 % fällig am 02.10.2031 (g)		600	530	0,33
Kookmin Bank				
2,500 % fällig am 04.11.2030 (g)		1.100	894	0,56
Kuwait Projects Co. SPC Ltd.				
4,500 % fällig am 23.02.2027		482	411	0,26
MAF Sukuk Ltd.				
4,638 % fällig am 14.05.2029		1.000	979	0,61
MDGH GMTN RSC Ltd.				
5,500 % fällig am 28.04.2033		300	316	0,20
Muthoot Finance Ltd.				
4,400 % fällig am 02.09.2023		213	212	0,13
NBK SPC Ltd.				
1,625 % fällig am 15.09.2027		2.000	1.786	1,12
NE Property BV				
1,875 % fällig am 09.10.2026	€	500	474	0,30
2,000 % fällig am 20.01.2030		100	81	0,05
NWD Finance BVI Ltd.				
4,125 % fällig am 10.03.2028 (e)	$	400	272	0,17
6,250 % fällig am 07.03.2024 (e)		200	147	0,09
OEC Finance Ltd. (4,375 % bar oder 4,375 % PIK)				
4,375 % fällig am 25.10.2029 (a)		742	33	0,02
OEC Finance Ltd. (5,250 % bar oder 5,250 % PIK)				
5,250 % fällig am 27.12.2033 (a)		457	22	0,01
OEC Finance Ltd. (7,125 % bar oder 7,125 % PIK)				
7,125 % fällig am 26.12.2046 (a)		1.657	112	0,07
OTP Bank Nyrt				
8,750 % fällig am 15.05.2033		200	201	0,13
Powerlong Real Estate Holdings Ltd.				
5,950 % fällig am 30.04.2025		1.300	135	0,08
QNB Finance Ltd.				
2,625 % fällig am 12.05.2025		500	475	0,30
Sberbank of Russia Via SB Capital S.A.				
5,250 % fällig am 23.05.2023 ^(g)		1.700	102	0,06
Seazen Group Ltd.				
4,450 % fällig am 13.07.2025		1.400	728	0,46
Shinhan Bank Co. Ltd.				
4,500 % fällig am 26.03.2028		900	847	0,53
Shinhan Card Co. Ltd.				
2,500 % fällig am 27.01.2027		500	446	0,28
+Shriram Finance Ltd.				
4,150 % fällig am 18.07.2025		327	309	0,19
SNB Funding Ltd.				
2,900 % fällig am 29.01.2027		1.700	1.591	1,00
Sovcombank Via SovCom Capital DAC				
3,400 % fällig am 26.01.2025 ^		1.100	30	0,02
Standard Chartered PLC				
6,170 % fällig am 09.01.2027		500	500	0,31
7,767 % fällig am 16.11.2028		700	743	0,46
Sunac China Holdings Ltd.				
6,500 % fällig am 09.07.2023 ^		500	78	0,05
7,000 % fällig am 09.07.2025 ^		600	91	0,06
Trust Fibra Uno				
6,390 % fällig am 15.01.2050		600	475	0,30
Turkiye Is Bankasi A/S				
6,125 % fällig am 25.04.2024		200	196	0,12
Woori Bank				
4,750 % fällig am 30.04.2024 (g)		1.000	986	0,62
Yango Justice International Ltd.				
7,500 % fällig am 17.02.2025 ^		400	3	0,00
7,875 % fällig am 04.09.2024 ^		200	3	0,00
Yanlord Land HK Co. Ltd.				
5,125 % fällig am 20.05.2026		600	494	0,31
			36.941	23,13
INDUSTRIEWERTE				
Abu Dhabi National Energy Co. PJSC				
4,375 % fällig am 24.01.2029	$	1.100	$ 1.088	0,68
Adani Electricity Mumbai Ltd.				
3,949 % fällig am 12.02.2030		400	298	0,19
Alfa Desarrollo SpA				
4,550 % fällig am 27.09.2051		995	731	0,46
ALROSA Finance S.A.				
3,100 % fällig am 25.06.2027 ^		1.100	66	0,04
Andrade Gutierrez International S.A. (9,000 % bar oder 10,500 % PIK)				
9,000 % fällig am 28.12.2029 (a)		1	0	0,00
AngloGold Ashanti Holdings PLC				
3,375 % fällig am 01.11.2028		200	175	0,11
3,750 % fällig am 01.10.2030		300	258	0,16
6,500 % fällig am 15.04.2040		800	807	0,51
Antofagasta PLC				
2,375 % fällig am 14.10.2030		700	571	0,36
5,625 % fällig am 13.05.2032		200	199	0,12
ATP Tower Holdings LLC				
4,050 % fällig am 27.04.2026		500	430	0,27
Axiata SPV2 Bhd.				
2,163 % fällig am 19.08.2030		300	255	0,16
Axiata SPV5 Labuan Ltd.				
3,064 % fällig am 19.08.2050		500	349	0,22
BOC Aviation USA Corp.				
1,625 % fällig am 29.04.2024		700	676	0,42
Braskem Netherlands Finance BV				
4,500 % fällig am 10.01.2028		700	644	0,40
Canacol Energy Ltd.				
5,750 % fällig am 24.11.2028		700	599	0,38
Celulosa Arauco y Constitucion S.A.				
5,500 % fällig am 30.04.2049		700	587	0,37
Champion Path Holdings Ltd.				
4,850 % fällig am 27.01.2028		200	162	0,10
China Modern Dairy Holdings Ltd.				
2,125 % fällig am 14.07.2026		600	514	0,32
CK Hutchison International Ltd.				
4,750 % fällig am 21.04.2028		500	495	0,31
Constellation Oil Services Holding S.A. (3,000 % bar und 4,000 % PIK)				
3,000 % fällig am 31.12.2026 (a)		307	182	0,11
Corp. GEO S.A.B. de C.V.				
8,875 % fällig am 25.09.2014 ^		850	0	0,00
CSN Inova Ventures				
6,750 % fällig am 28.01.2028		700	650	0,41
CT Trust				
5,125 % fällig am 03.02.2032		1.000	804	0,50
Digicel International Finance Ltd.				
8,750 % fällig am 25.05.2024		145	133	0,08
Ecopetrol S.A.				
6,875 % fällig am 29.04.2030		1.800	1.643	1,03
7,375 % fällig am 18.09.2043		800	668	0,42
Energean Israel Finance Ltd.				
5,375 % fällig am 30.03.2028		700	633	0,40
Fomento Economico Mexicano S.A.B. de C.V.				
4,375 % fällig am 10.05.2043		600	528	0,33
Fortune Star BVI Ltd.				
3,950 % fällig am 02.10.2026	€	200	151	0,09
5,000 % fällig am 18.05.2026	$	500	376	0,24
5,950 % fällig am 19.10.2025		300	241	0,15
Freeport Indonesia PT				
4,763 % fällig am 14.04.2027		900	873	0,55
6,200 % fällig am 14.04.2052		800	723	0,45
Fresnillo PLC				
4,250 % fällig am 02.10.2050		800	600	0,38
GEMS MENASA Cayman Ltd.				
7,125 % fällig am 31.07.2026		200	194	0,12
Geopark Ltd.				
5,500 % fällig am 17.01.2027		800	651	0,41
Gold Fields Orogen Holdings BVI Ltd.				
6,125 % fällig am 15.05.2029		700	709	0,44
Greensaif Pipelines Bidco SARL				
6,129 % fällig am 23.02.2038		500	511	0,32
6,510 % fällig am 23.02.2042		200	208	0,13

BESCHREIBUNG		PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
Grupo Bimbo S.A.B. de C.V.				
4,000 % fällig am 06.09.2049	$	500	$ 405	0,25
Guara Norte SARL				
5,198 % fällig am 15.06.2034		1.415	1.240	0,78
Health & Happiness International Holdings Ltd.				
13,500 % fällig am 26.06.2026		800	757	0,47
Hikma Finance USA LLC				
3,250 % fällig am 09.07.2025		1.000	949	0,59
HTA Group Ltd.				
7,000 % fällig am 18.12.2025		600	569	0,36
IHS Netherlands Holdco BV				
8,000 % fällig am 18.09.2027		760	695	0,44
Industrias Penoles S.A.B. de C.V.				
4,750 % fällig am 06.08.2050		800	637	0,40
InRetail Consumer				
3,250 % fällig am 22.03.2028		1.200	1.032	0,65
Invepar Holdings LLC				
1,000 % fällig am 31.12.2049 (h)		210	0	0,00
Inversiones CMPC S.A.				
3,000 % fällig am 06.04.2031		500	414	0,26
JSW Steel Ltd.				
5,050 % fällig am 05.04.2032		600	486	0,30
KazMunayGas National Co. JSC				
5,750 % fällig am 19.04.2047		200	163	0,10
6,375 % fällig am 24.10.2048		1.500	1.286	0,81
Kosmos Energy Ltd.				
7,125 % fällig am 04.04.2026		1.010	889	0,56
7,750 % fällig am 01.05.2027		200	172	0,11
Lenovo Group Ltd.				
3,421 % fällig am 02.11.2030		200	169	0,11
Leviathan Bond Ltd.				
6,500 % fällig am 30.06.2027		800	768	0,48
LG Chem Ltd.				
3,625 % fällig am 15.04.2029		1.600	1.494	0,94
Medco Oak Tree Pte. Ltd.				
7,375 % fällig am 14.05.2026		700	689	0,43
Melco Resorts Finance Ltd.				
4,875 % fällig am 06.06.2025		600	572	0,36
5,375 % fällig am 04.12.2029		400	332	0,21
5,625 % fällig am 17.07.2027		700	635	0,40
5,750 % fällig am 21.07.2028		400	354	0,22
Metalsa S.A. de C.V.				
3,750 % fällig am 04.05.2031		800	631	0,39
Metinvest BV				
5,625 % fällig am 17.06.2025	€	850	658	0,41
MGM China Holdings Ltd.				
5,375 % fällig am 15.05.2024	$	800	788	0,49
Nakilat, Inc.				
6,067 % fällig am 31.12.2033		357	374	0,23
OAS Restructuring BVI Ltd.				
5,000 % fällig am 31.03.2035 (h)	BRL	475	5	0,00
OCP S.A.				
5,125 % fällig am 23.06.2051	$	1.400	1.024	0,64
6,875 % fällig am 25.04.2044		500	461	0,29
Odebrecht Holdco Finance Ltd.				
0,000 % fällig am 10.09.2058 (c)		3.424	22	0,01
Odebrecht Oil & Gas Finance Ltd.				
0,000 % fällig am 31.07.2023 (c)(e)		1.416	3	0,00
ONGC Videsh Vankorneft Pte. Ltd.				
3,750 % fällig am 27.07.2026		1.000	946	0,59
Periama Holdings LLC				
5,950 % fällig am 19.04.2026		300	289	0,18
Pertamina Persero PT				
5,625 % fällig am 20.05.2043		800	772	0,48
Petron Corp.				
5,950 % fällig am 19.04.2026 (e)		300	279	0,17
Petronas Capital Ltd.				
3,404 % fällig am 28.04.2061		700	500	0,31
Petrorio Luxembourg Trading SARL				
6,125 % fällig am 09.06.2026		500	481	0,30
Prosus NV				
3,061 % fällig am 13.07.2031		1.300	1.017	0,64
3,257 % fällig am 19.01.2027		200	181	0,11
4,987 % fällig am 19.01.2052		1.000	722	0,45
Ras Laffan Liquefied Natural Gas Co. Ltd.				
6,332 % fällig am 30.09.2027	$	588	$ 600	0,38
Rede D'or Finance SARL				
4,500 % fällig am 22.01.2030		213	182	0,11
Reliance Industries Ltd.				
2,875 % fällig am 12.01.2032		900	751	0,47
ReNew Power Pvt Ltd.				
5,875 % fällig am 05.03.2027		300	281	0,18
Sands China Ltd.				
3,350 % fällig am 08.03.2029		300	250	0,16
4,300 % fällig am 08.01.2026		200	188	0,12
4,875 % fällig am 18.06.2030		450	401	0,25
5,625 % fällig am 08.08.2025		300	293	0,18
5,900 % fällig am 08.08.2028		900	859	0,54
Sasol Financing USA LLC				
5,875 % fällig am 27.03.2024		500	494	0,31
6,500 % fällig am 27.09.2028		1.700	1.522	0,95
Saudi Arabian Oil Co.				
2,250 % fällig am 24.11.2030		1.600	1.334	0,84
4,250 % fällig am 16.04.2039		1.500	1.326	0,83
Seplat Energy PLC				
7,750 % fällig am 01.04.2026		400	337	0,21
Severstal OAO Via Steel Capital S.A.				
3,150 % fällig am 16.09.2024 ^		800	38	0,02
Sitios Latinoamerica S.A.B. de C.V.				
5,375 % fällig am 04.04.2032		900	816	0,51
SK Hynix, Inc.				
2,375 % fällig am 19.01.2031		800	618	0,39
6,375 % fällig am 17.01.2028		400	402	0,25
SK on Co. Ltd.				
5,375 % fällig am 11.05.2026		700	694	0,43
SMC Global Power Holdings Corp.				
5,450 % fällig am 09.12.2026 (e)		400	291	0,18
Stillwater Mining Co.				
4,000 % fällig am 16.11.2026		1.400	1.250	0,78
Studio City Co. Ltd.				
7,000 % fällig am 15.02.2027		800	750	0,47
Sunny Optical Technology Group Co. Ltd.				
5,950 % fällig am 17.07.2026		600	599	0,38
Suzano Austria GmbH				
3,750 % fällig am 15.01.2031		300	256	0,16
7,000 % fällig am 16.03.2047		400	404	0,25
Telecomunicaciones Digitales S.A.				
4,500 % fällig am 30.01.2030		300	255	0,16
Tengizchevroil Finance Co. International Ltd.				
3,250 % fällig am 15.08.2030		700	536	0,34
Teva Pharmaceutical Finance Netherlands BV				
3,750 % fällig am 09.05.2027	€	1.900	1.880	1,19
TMS Issuer SARL				
5,780 % fällig am 23.08.2032	$	200	206	0,13
Turkish Airlines Pass-Through Trust				
4,200 % fällig am 15.09.2028		649	598	0,37
Unigel Luxembourg S.A.				
8,750 % fällig am 01.10.2026		900	296	0,19
Vale Overseas Ltd.				
3,750 % fällig am 08.07.2030		400	352	0,22
6,875 % fällig am 21.11.2036		700	733	0,46
Vale S.A.				
0,000 % (e)	BRL	6.700	427	0,27
Wynn Macau Ltd.				
4,875 % fällig am 01.10.2024	$	500	488	0,31
5,500 % fällig am 15.01.2026		500	465	0,29
YPF S.A.				
6,950 % fällig am 21.07.2027		300	247	0,15
Yunda Holding Investment Ltd.				
2,250 % fällig am 19.08.2025		500	450	0,28
Zhongsheng Group Holdings Ltd.				
3,000 % fällig am 13.01.2026		700	638	0,40
			65.749	41,17
VERSORGUNGSUNTERNEHMEN				
Cikarang Listrindo Tbk PT				
4,950 % fällig am 14.09.2026		500	477	0,30
Empresa Electrica Cochrane SpA				
5,500 % fällig am 14.05.2027		180	167	0,10
Greenko Solar Mauritius Ltd.				
5,550 % fällig am 29.01.2025	$	700	$ 676	0,42
IHS Holding Ltd.				
5,625 % fällig am 29.11.2026		400	350	0,22
India Green Energy Holdings				
5,375 % fällig am 29.04.2024		750	733	0,46
Israel Electric Corp. Ltd.				
3,750 % fällig am 22.02.2032		200	171	0,11
4,250 % fällig am 14.08.2028		1.600	1.494	0,94
LLPL Capital Pte. Ltd.				
6,875 % fällig am 04.02.2039		662	595	0,37
MSU Energy S.A.				
6,875 % fällig am 01.02.2025		400	280	0,18
NGD Holdings BV				
6,750 % fällig am 31.12.2026		284	209	0,13
Peru LNG SRL				
5,375 % fällig am 22.03.2030		500	403	0,25
Perusahaan Perseroan Persero PT Perusahaan Listrik Negara				
5,250 % fällig am 24.10.2042		300	268	0,17
Rio Oil Finance Trust				
8,200 % fällig am 06.04.2028		887	893	0,56
9,250 % fällig am 06.07.2024		56	56	0,04
9,750 % fällig am 06.01.2027		500	517	0,32
Saudi Electricity Sukuk Programme Co.				
5,684 % fällig am 11.04.2053		400	397	0,25
Southern Gas Corridor CJSC				
6,875 % fällig am 24.03.2026		900	916	0,57
Star Energy Geothermal Wayang Windu Ltd.				
6,750 % fällig am 24.04.2033		405	398	0,25
Thaioil Treasury Center Co. Ltd.				
3,750 % fällig am 18.06.2050		700	469	0,29
			9.469	5,93
Summe Unternehmensanleihen und Wechsel			112.159	70,23
US-REGIERUNGSBEHÖRDEN				
Uniform Mortgage-Backed Security, TBA				
5,000 % fällig am 01.09.2053		3.100	3.040	1,90
US-SCHATZOBLIGATIONEN				
U.S. Treasury Bonds				
3,000 % fällig am 15.05.2045		8.000	6.762	4,23
NON-AGENCY-MBS				
Canada Square Funding PLC				
5,316 % fällig am 17.01.2059	£	92	116	0,07
Chevy Chase Funding LLC Mortgage-Backed Certificates				
5,380 % fällig am 25.10.2035	$	404	375	0,23
Citigroup Mortgage Loan Trust				
3,938 % fällig am 25.08.2036		271	239	0,15
Countrywide Alternative Loan Trust				
5,797 % fällig am 20.12.2035		48	45	0,03
Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust				
3,884 % fällig am 25.11.2037		32	29	0,02
Polaris PLC				
6,154 % fällig am 27.05.2057	£	46	58	0,04
Rochester Financing PLC				
5,602 % fällig am 18.12.2044		131	165	0,10
Tower Bridge Funding PLC				
5,629 % fällig am 20.12.2063		87	110	0,07
			1.137	0,71
FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE				
Citigroup Mortgage Loan Trust				
7,250 % fällig am 25.05.2036	$	361	192	0,12
Countrywide Asset-Backed Certificates Trust				
5,370 % fällig am 25.09.2037 ^		36	37	0,02
Home Equity Mortgage Loan Asset-Backed Trust				
5,340 % fällig am 25.04.2037		136	89	0,06
JPMorgan Mortgage Acquisition Corp.				
6,125 % fällig am 25.12.2035		1.100	992	0,62
NovaStar Mortgage Funding Trust				
5,350 % fällig am 25.09.2037		108	105	0,07
			1.415	0,89

BESCHREIBUNG		PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
STAATSEMISSIONEN				
Argentina Government International Bond				
0,500 % fällig am 09.07.2030	$	18	$ 5	0,00
1,500 % fällig am 09.07.2035		11	3	0,00
Chile Government International Bond				
4,340 % fällig am 07.03.2042		900	801	0,50
Colombia Government International Bond				
4,500 % fällig am 28.01.2026		1.000	954	0,60
Zentralbanknoten der Dominikanischen Republik				
13,000 % fällig am 05.12.2025	DOP	25.900	505	0,32
Dominican Republic Government International Bond				
5,300 % fällig am 21.01.2041	$	200	157	0,10
7,050 % fällig am 03.02.2031		200	200	0,13
Export-Credit Bank of Turkey				
8,250 % fällig am 24.01.2024		600	600	0,38
9,375 % fällig am 31.01.2026		300	299	0,19
Ungarische Entwicklungsbank				
6,500 % fällig am 29.06.2028		200	198	0,12
Oman Government International Bond				
6,250 % fällig am 25.01.2031		400	407	0,25
Peru Government International Bond				
7,300 % fällig am 12.08.2033	PEN	800	228	0,14
Poland Government International Bond				
4,250 % fällig am 14.02.2043	€	400	429	0,27
Romania Government International Bond				
2,000 % fällig am 14.04.2033		400	309	0,19
4,625 % fällig am 03.04.2049		500	422	0,26
Saudi Arabia Government International Bond				
4,875 % fällig am 18.07.2033	$	300	300	0,19
5,000 % fällig am 18.01.2053		200	186	0,12
Turkey Government International Bond				
4,875 % fällig am 16.04.2043		300	193	0,12
9,375 % fällig am 19.01.2033	$	500	$ 503	0,31
Ukraine Government International Bond				
4,375 % fällig am 27.01.2032 ^	€	300	72	0,05
7,750 % fällig am 01.09.2026 ^	$	300	73	0,05
			6.844	4,29
		AKTIEN		
STAMMAKTIEN				
ENERGIE				
Constellation Oil Services Holding S.A. 'B' (b)(h)		361.648	39	0,02
FINANZWERTE				
Hipotecaria Su Casita S.A. (b)		332.624	0	0,00
BAUSTOFFE				
Petra Diamonds Ltd. (b)		331.402	284	0,18
			323	0,20
OPTIONSSCHEINE				
OAS S.A. - Exp. 21.01.2039 (h)		175.616	0	0,00
		PAR (000S)		
KURZFRISTIGE INSTRUMENTE				
COMMERCIAL PAPER				
Dominion Resources, Inc.				
5,430 % fällig am 31.07.2023	$	0 25	249	0,15
Electricite de France S.A.				
5,510 % fällig am 03.08.2023		0 30	298	0,19
Mondelez International, Inc.				
5,430 % fällig am 14.07.2023	$	300	$ 299	0,19
National Grid Holdings Ltd.				
5,450 % fällig am 13.07.2023		300	300	0,19
			1.146	0,72
JAPAN TREASURY BILLS				
(0,200) % fällig am 24.07.2023 (c)(d)	¥	430.000	2.975	1,86
Summe kurzfristige Instrumente			4.121	2,58
Summe Übertragbare Wertpapiere			**$ 138.695**	**86,84**
		AKTIEN		
INVESTMENTFONDS				
ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN				
PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (f)		1.535.731	15.293	9,57
PIMCO Specialty Funds Ireland p.l.c. - PIMCO China Bond Fund (f)		25.272	329	0,21
			15.622	9,78
BÖRSENGEHANDELTE FONDS				
PIMCO ETFs plc - PIMCO US Dollar Short Maturity UCITS ETF (f)		1.000	99	0,06
Summe Investmentfonds			**$ 15.721**	**9,84**

PENSIONSGESCHÄFTE

Kontrahent	Kredit-zins	Abrechnungs-datum	Fälligkeits-datum	Kapital-betrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensions-geschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensions-geschäft[1]	% des Nettovermögens
FICC	2,400 %	30.06.2023	03.07.2023	$ 449	U.S. Treasury Notes 4,625 % fällig am 30.06.2025	$ (458)	$ 449	$ 449	0,28
	5,060	30.06.2023	03.07.2023	3.500	U.S. Treasury Notes 1,375 % fällig am 15.11.2031	(3.570)	3.500	3.500	2,19
Summe Pensionsgeschäfte						**$ (4.028)**	**$ 3.949**	**$ 3.949**	**2,47**

(1) Umfasst aufgelaufene Zinsen.

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

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

FUTURES

Beschreibung	Art	Ablauf-monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Euro-Bund 10-Year Bond September Futures	Short	09.2023	23	$ 32	0,02
U.S. Treasury 2-Year Note September Futures	Long	09.2023	187	(534)	(0,34)
U.S. Treasury 5-Year Note September Futures	Long	09.2023	18	(37)	(0,02)
U.S. Treasury 10-Year Note September Futures	Long	09.2023	20	(39)	(0,03)
U.S. Treasury 10-Year Ultra September Futures	Short	09.2023	7	8	0,01
U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond September Futures	Short	09.2023	39	(77)	(0,05)
				$ (647)	(0,41)
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate				**$ (647)**	**(0,41)**

ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)

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

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMMISSIONEN - SCHUTZVERKAUF[1]

Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag[2]	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Jaguar Land Rover Automotive PLC	5,000 %	20.06.2026	€ 100	$ (5)	0,00

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES - SCHUTZVERKAUF[1]

Index/Tranchen	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag[2]	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
CDX.EM-39 5-Year Index	1,000 %	20.06.2028	$ 3.800	$ 10	0,01
CDX.HY-40 5-Year Index	5,000	20.06.2028	400	11	0,01
CDX.IG-40 5-Year Index	1,000	20.06.2028	2.400	17	0,01
iTraxx Asia Ex-Japan 39 5-Year Index	1,000	20.06.2028	3.500	39	0,02
iTraxx Crossover 39 5-Year Index	5,000	20.06.2028	€ 1.100	30	0,02
iTraxx Europe Main 39 5-Year Index	1,000	20.06.2028	1.900	20	0,01
				$ 127	0,08

ZINSSWAPS

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,000 %	21.09.2024	$ 12.500	$ 429	0,27
Erhalt[3]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,750	21.06.2047	1.700	182	0,11
Zahlung	1-Year BRL-CDI	12,090	04.01.2027	BRL 6.500	8	0,00
Zahlung	3-Month KRW-KORIBOR	2,665	15.03.2028	KRW 999.100	(3)	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,750	21.09.2023	$ 1.700	17	0,01
Erhalt	3-Month ZAR-JIBAR	7,205	22.04.2027	ZAR 7.200	17	0,01
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	7,210	22.04.2027	35.600	(27)	(0,02)
Zahlung	6-Month CZK-PRIBOR	4,611	06.06.2028	CZK 17.200	(5)	0,00
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR	4,930	29.06.2028	PLN 1.700	(1)	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	8,207	19.06.2028	MXN 6.900	(3)	0,00
					$ 614	0,38
Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate					**$ 736**	**0,46**

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

(2) Der maximal mögliche Betrag, den der Fonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

(3) Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft.

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

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

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMMISSIONEN - SCHUTZVERKAUF[1]

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag[2]	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Markt-wert	% des Nettovermögens
BRC	America Movil S.A.B. de C.V.	1,000 %	20.12.2025	$ 1.200	$ (30)	$ 42	$ 12	0,01
	Turkey Government International Bond	1,000	20.06.2028	500	(87)	12	(75)	(0,05)
CBK	Mexico Government International Bond	1,000	20.06.2026	50	0	1	1	0,00
	South Africa Government International Bond	1,000	20.12.2026	900	(42)	10	(32)	(0,02)
GST	Poland Government International Bond	1,000	20.06.2024	300	1	1	2	0,00
JPM	Banco do Brasil S.A.	1,000	20.12.2024	400	(9)	6	(3)	0,00
MYC	Mexico Government International Bond	1,000	20.06.2028	400	(9)	8	(1)	0,00
					$ (176)	$ 80	$ (96)	(0,06)

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

(2) Der maximal mögliche Betrag, den der Fonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2023	€ 31	$ 34	$ 0	$ 0	$ 0	0,00
	07.2023	PLN 2.207	542	0	(1)	(1)	0,00
	08.2023	$ 198	CNY 1.361	0	(10)	(10)	(0,01)
	09.2023	PHP 17.450	$ 315	0	0	0	0,00
	09.2023	$ 105	HKD 822	0	0	0	0,00
	11.2023	519	ILS 1.865	0	(13)	(13)	(0,01)

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung		Zu erhaltende Währung		Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BPS	07.2023	CZK	736	$	34	$ 0	$ 0	$ 0	0,00
	07.2023	$	6.394	€	5.835	0	(27)	(27)	(0,02)
	08.2023	CNH	6.188	$	898	44	0	44	0,03
	08.2023	€	5.835		6.403	28	0	28	0,02
	08.2023	$	234	CNY	1.601	0	(13)	(13)	(0,01)
	08.2023		26	ZAR	475	0	0	0	0,00
	08.2023	ZAR	668	$	36	1	0	1	0,00
	10.2023		7.578		407	10	0	10	0,01
	11.2023	ILS	3.988		1.152	70	0	70	0,04
BRC	08.2023	COP	1.828.778		429	0	(3)	(3)	0,00
	08.2023	$	31	ZAR	575	0	(1)	(1)	0,00
BSH	08.2023		504	BRL	2.456	3	0	3	0,00
CBK	07.2023	€	94	$	101	0	(2)	(2)	0,00
	07.2023	ILS	5.208		1.570	166	0	166	0,10
	07.2023	$	93	€	85	0	0	0	0,00
	07.2023		698	£	552	4	0	4	0,00
	08.2023	COP	1.339.576	$	317	0	0	0	0,00
	09.2023		285.244		68	1	0	1	0,00
DUB	07.2023	BRL	1.499		277	0	(34)	(34)	(0,02)
	10.2023	ZAR	6.500		357	16	0	16	0,01
GLM	07.2023	DOP	24.918		430	0	(16)	(16)	(0,01)
	07.2023	$	312	BRL	1.504	0	0	0	0,00
	09.2023	BRL	1.521	$	312	0	0	0	0,00
	09.2023	$	425	THB	15.007	1	0	1	0,00
	10.2023	ZAR	2.087	$	112	3	0	3	0,00
JPM	08.2023	CNH	2.932		424	20	0	20	0,01
	08.2023	COP	786.729		186	0	(1)	(1)	0,00
	08.2023	$	247	CNY	1.689	0	(13)	(13)	(0,01)
	08.2023	ZAR	480	$	25	0	(1)	(1)	0,00
	09.2023	COP	370.343		87	0	0	0	0,00
	09.2023	$	4	ILS	13	0	0	0	0,00
	09.2023		360	MXN	6.245	0	(1)	(1)	0,00
MBC	07.2023	£	1.101	$	1.363	0	(37)	(37)	(0,02)
	09.2023	$	331	IDR	4.964.613	0	(1)	(1)	0,00
	09.2023		504	INR	41.455	0	0	0	0,00
MYI	07.2023		5	€	4	0	0	0	0,00
	07.2023		1.451	ILS	5.226	0	(42)	(42)	(0,03)
	07.2023		299	MYR	1.394	0	0	0	0,00
	09.2023	PEN	829	$	227	0	(1)	(1)	0,00
	09.2023	$	331	PEN	1.208	0	0	0	0,00
	11.2023		1.145	ILS	4.047	0	(48)	(48)	(0,03)
RBC	07.2023	¥	430.000	$	3.294	311	0	311	0,19
SCX	08.2023	CNH	1.390		202	10	0	10	0,01
	08.2023	$	657	CNY	4.484	0	(36)	(36)	(0,02)
SOG	07.2023	€	5.795	$	6.234	0	(88)	(88)	(0,05)
TOR	07.2023	$	1.399	£	1.101	1	0	1	0,00
	08.2023	£	1.101	$	1.399	0	(1)	(1)	0,00
UAG	08.2023	ZAR	7.538		393	0	(5)	(5)	0,00
	09.2023	$	96	ZAR	1.685	0	(8)	(8)	0,00
	11.2023	ILS	1.993	$	576	36	0	36	0,02
						$ 725	$ (403)	$ 322	0,20

ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklasse Class E CHF (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung		Zu erhaltende Währung		Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BPS	07.2023	CHF	3.025	$	3.382	$ 1	$ 0	$ 1	0,00
	07.2023	$	4.519	CHF	4.088	51	0	51	0,03
	08.2023		3.382		3.016	0	(1)	(1)	0,00
JPM	07.2023	CHF	20	$	22	0	0	0	0,00
MBC	07.2023		7		7	0	0	0	0,00
MYI	07.2023		145		160	0	(2)	(2)	0,00
SCX	07.2023	$	3.251	CHF	2.921	14	0	14	0,01
UAG	07.2023	CHF	3.123	$	3.484	0	(7)	(7)	0,00
	07.2023	$	2.929	CHF	2.632	13	0	13	0,01
	08.2023		3.484		3.114	7	0	7	0,00
						$ 86	$ (10)	$ 76	0,05

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklassen Institutional EUR (Hedged) thesaurierend und Class E EUR (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung		Zu erhaltende Währung		Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2023	€	13	$	14	$ 0	$ 0	$ 0	0,00
	07.2023	$	41.000	€	38.150	622	0	622	0,39
BPS	07.2023	€	38.555	$	42.244	181	(1)	180	0,11

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
	07.2023	$ 40.945	€ 38.088	$ 609	$ 0	$ 609	0,38
	08.2023	42.098	38.367	0	(182)	(182)	(0,11)
CBK	07.2023	€ 39.264	$ 42.667	0	(170)	(170)	(0,11)
	08.2023	$ 40.863	€ 37.532	141	0	141	0,09
JPM	07.2023	€ 38.338	$ 41.861	34	0	34	0,02
	07.2023	$ 1.995	€ 1.866	41	0	41	0,03
	08.2023	41.920	38.338	0	(36)	(36)	(0,02)
MBC	07.2023	€ 30	$ 32	0	0	0	0,00
	07.2023	$ 5	€ 5	0	0	0	0,00
SOG	07.2023	40.973	38.088	581	0	581	0,36
				$ 2.209	$ (389)	$ 1.820	1,14
Summe Freiverkehrsfinanzderivate						**$ 2.122**	**1,33**

BESCHREIBUNG		PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
EINLAGENZERTIFIKATE				
Banco Davivienda S.A.				
13,501 % fällig am 13.12.2024	COP	714.000	$ 171	0,11
BanColombia S.A.				
5,917 % fällig am 27.01.2024		1.097.400	253	0,16
13,320 % fällig am 08.06.2025		369.000	89	0,05
13,637 % fällig am 14.12.2024		978.000	235	0,15
16,137 % fällig am 01.09.2024		400.000	97	0,06
BBVA Colombia S.A.				
5,870 % fällig am 15.07.2024		816.000	184	0,11
14,540 % fällig am 13.01.2024		467.400	111	0,07
Summe Einlagenzertifikate			**$ 1.140**	**0,71**
Summe Anlagen			**$ 161.716**	**101,24**
Sonstige Aktiva und Passiva			**$ (1.983)**	**(1,24)**
Nettovermögen			**$ 159.733**	**100,00**

ERLÄUTERUNGEN ZUR AUFSTELLUNG DES WERTPAPIERBESTANDS (Angaben in Tausend*):

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

^ Das Wertpapier ist in Verzug.

(a) Wertpapier mit Sachwertausschüttung.

(b) Das Wertpapier hat in den letzten zwölf Monaten keine Erträge geliefert.

(c) Nullkuponwertpapier.

(d) Der Kupon stellt eine Rendite bis zur Endfälligkeit dar.

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

(f) Mit dem Fonds verbunden.

(g) Bedingt wandelbares Wertpapier.

(h) Eingeschränkte Wertpapiere (31. Dezember 2022: 0,79 %):

Emittentenbeschreibung	Kauf-datum	Kosten	Markt-wert	% des Nettovermögens
Constellation Oil Services Holding S.A. 'B'	10.06.2022	$ 39	$ 39	0,03
Development Bank of Southern Africa 8,600 % fällig am 21.10.2024	07.10.2021	1.498	1.160	0,76
Invepar Holdings LLC 1,000 % fällig am 31.12.2049	16.11.2018	0	0	0,00
OAS Restructuring BVI Ltd, 5,000 % fällig am 31.03.2035	16.11.2018	14	5	0,00
OAS S.A. - Exp. 21.01.2039	16.11.2018	5	0	0,00
		$ 1.556	$ 1.204	0,79

Barmittel in Höhe von 1.722 USD (31. Dezember 2022: 1.839 USD) wurden zum 30. Juni 2023 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Beizulegender Zeitwert[1]

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 30. Juni 2023 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie[2]	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	$ 0	$ 135.341	$ 3.354	$ 138.695
Investmentfonds	15.721	0	0	15.721
Pensionsgeschäfte	0	3.949	0	3.949
Finanzderivate[3]	32	2.179	0	2.211
Einlagen bei Kreditinstituten	0	364	776	1.140
Summen	**$ 15.753**	**$ 141.833**	**$ 4.130**	**$ 161.716**

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

Kategorie[2]	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	$ 458	$ 140.620	$ 2.309	$ 143.387
Investmentfonds	16.419	99	0	16.518
Pensionsgeschäfte	0	8.386	0	8.386
Finanzderivate[3]	191	3.630	0	3.821
Summen	**$ 17.068**	**$ 152.735**	**$ 2.309**	**$ 172.112**

(1) Weitere Informationen finden Sie in den Erläuterungen in Erläuterung 3.

(2) Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung des Wertpapierbestands.

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

Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC-Finanzderivate und -Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2023 und 31. Dezember 2022:

	Zum 30. Jun. 2023			Zum 31. Dez. 2022		
Kontrahent	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-engagement[1]	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-engagement[1]
AZD	$ k. A.	$ k. A.	$ k. A.	$ (141)	$ 0	$ (141)
BOA	598	(460)	138	92	(40)	52
BPS	771	(750)	21	(36)	0	(36)
BRC	(67)	0	(67)	(2)	0	(2)
BSH	3	0	3	k. A.	k. A.	k. A.
CBK	109	0	109	1.221	(1.150)	71
DUB	(18)	0	(18)	k. A.	k. A.	k. A.
GLM	(12)	0	(12)	1	0	1
GST	2	0	2	k. A.	k. A.	k. A.
JPM	40	0	40	14	0	14
MBC	(38)	0	(38)	648	(550)	98
MYC	(1)	0	(1)	(5)	0	(5)
MYI	(93)	0	(93)	76	0	76
RBC	311	(280)	31	k. A.	k. A.	k. A.
SCX	(12)	0	(12)	981	(940)	41
SOG	493	(370)	123	k. A.	k. A.	k. A.
UAG	36	0	36	(36)	0	(36)

(1) Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären.

Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung des Wertpapierbestands zum 30. Juni 2023:

	30. Jun. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	68,61	67,07
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	18,23	17,79
Investmentfonds	9,84	9,77
Pensionsgeschäfte	2,47	4,96
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	(0,41)	0,10
Zentral abgerechnete Finanzderivate	0,46	0,50
Freiverkehrsfinanzderivate	1,33	1,66
Einlagenzertifikate	0,71	k. A.

Das Anlageportfolio des Fonds konzentriert sich zum 30. Juni 2023 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	30. Jun. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
Kreditbeteiligungen und -abtretung	1,81	1,15
Unternehmensanleihen und Wechsel	70,23	70,02
US-Regierungsbehörden	1,90	0,76
US-Schatzobligationen	4,23	3,90
Non-Agency-MBS	0,71	0,77
Forderungsbesicherte Wertpapiere	0,89	0,84
Staatsemissionen	4,29	3,53
Stammaktien	0,20	0,52
Optionsscheine	0,00	0,00
Kurzfristige Instrumente	2,58	3,37
Investmentfonds	9,84	9,77
Pensionsgeschäfte	2,47	4,96
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	(0,41)	0,10
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen — Schutzverkauf	0,00	(0,01)
Credit Default Swaps auf Kreditindizes— Schutzverkauf	0,08	0,20
Zinsswaps	0,38	0,31

Anlagen zum Marktwert	30. Jun. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
Freiverkehrsfinanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen — Schutzverkauf	(0,06)	(0,02)
Volatilitätsswaps	k. A.	0,00
Devisenterminkontrakte	0,20	(0,24)
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	1,19	1,92
Einlagenzertifikate	0,71	k. A.
Sonstige Aktiva und Passiva	(1,24)	(1,85)
Nettovermögen	100,00	100,00

Aufstellung des Wertpapierbestands des PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund

BESCHREIBUNG		PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE				
BRASILIEN				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Banco BTG Pactual S.A.				
8,300 % fällig am 15.08.2024	BRL	10.000	$ 2.011	0,87
Oi S.A.				
0,000 % fällig am 25.02.2035		350	62	0,03
Vale S.A.				
0,000 % (e)		46.580	2.969	1,29
Summe Brasilien			5.042	2,19
CAYMAN INSELN				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Kaisa Group Holdings Ltd.				
9,375 % fällig am 30.06.2024 ^	$	3.400	226	0,10
9,750 % fällig am 28.09.2023 ^		700	47	0,02
11,700 % fällig am 11.11.2025 ^		200	13	0,01
Poinsettia Finance Ltd.				
6,625 % fällig am 17.06.2031		797	658	0,28
Sunac China Holdings Ltd.				
6,500 % fällig am 09.07.2023 ^		400	62	0,03
7,250 % fällig am 14.06.2022 ^		200	30	0,01
Summe Cayman Inseln			1.036	0,45
CHILE				
STAATSEMISSIONEN				
Bonos de la Tesoreria de la Republica en Pesos				
6,000 % fällig am 01.04.2033	CLP	6.390.000	8.433	3,66
CHINA				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Yango Justice International Ltd.				
7,500 % fällig am 17.02.2025 ^	$	1.100	10	0,00
KOLUMBIEN				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Ecopetrol S.A.				
5,875 % fällig am 28.05.2045		700	480	0,21
KONGO				
STAATSEMISSIONEN				
Belarus International Bond				
6,000 % fällig am 30.06.2029		625	529	0,23
TSCHECHISCHE REPUBLIK				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
EP Infrastructure A/S				
1,816 % fällig am 02.03.2031	€	1.400	1.073	0,47
STAATSEMISSIONEN				
Czech Republic Government International Bond				
2,000 % fällig am 13.10.2033	CZK	19.400	723	0,31
2,750 % fällig am 23.07.2029		49.000	2.050	0,89
			2.773	1,20
Summe Tschechische Republik			3.846	1,67
DÄNEMARK				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Nordea Kredit Realkreditaktieselskab				
1,000 % fällig am 01.10.2050	DKK	0	0	0,00
1,500 % fällig am 01.10.2053		0	0	0,00
Nykredit Realkredit A/S				
1,000 % fällig am 01.10.2050		0	0	0,00
1,500 % fällig am 01.10.2053		0	0	0,00
Realkredit Danmark A/S				
1,000 % fällig am 01.10.2050		0	0	0,00
1,000 % fällig am 01.10.2053		0	0	0,00
1,500 % fällig am 01.10.2053		0	0	0,00
TDC Net A/S				
6,500 % fällig am 01.06.2031	€	500	546	0,24
Summe Dänemark			546	0,24
DOMINIKANISCHE REPUBLIK				
STAATSEMISSIONEN				
Zentralbanknoten der Dominikanischen Republik				
12,000 % fällig am 03.10.2025	DO P	84.300	$ 1.602	0,69
13,000 % fällig am 05.12.2025		244.600	4.772	2,07
Dominican Republic Government International Bond				
13,625 % fällig am 03.02.2033		50.200	1.129	0,49
13,625 % fällig am 10.02.2034		56.700	1.295	0,56
Summe Dominikanische Republik			8.798	3,81
GUATEMALA				
STAATSEMISSIONEN				
Guatemala Government International Bond				
6,600 % fällig am 13.06.2036	$	900	907	0,39
UNGARN				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
MVM Energetika Zrt				
7,500 % fällig am 09.06.2028		600	599	0,26
STAATSEMISSIONEN				
Ungarische Entwicklungsbank				
6,500 % fällig am 29.06.2028		2.200	2.182	0,95
Summe Ungarn			2.781	1,21
INDIEN				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
JSW Hydro Energy Ltd.				
4,125 % fällig am 18.05.2031		588	497	0,21
IRLAND				
FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE				
Black Diamond CLO DAC				
4,060 % fällig am 20.01.2032	€	418	450	0,20
Cairn CLO DAC				
3,957 % fällig am 15.10.2031		800	856	0,37
Carlyle Euro CLO DAC				
3,877 % fällig am 15.01.2031		1.394	1.489	0,65
Carlyle Global Market Strategies Euro CLO Ltd.				
4,073 % fällig am 15.11.2031		1.300	1.392	0,60
Harvest CLO DAC				
4,250 % fällig am 26.06.2030		1.241	1.326	0,57
Oak Hill European Credit Partners DAC				
3,940 % fällig am 20.10.2031		500	531	0,23
			6.044	2,62
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Alfa Bank AO Via Alfa Bond Issuance PLC				
5,950 % fällig am 15.04.2030 ^(g)	$	900	54	0,03
Sovcombank Via SovCom Capital DAC				
8,000 % fällig am 07.04.2030 ^(g)		400	24	0,01
			78	0,04
NON-AGENCY-MBS				
European Loan Conduit DAC				
4,358 % fällig am 17.02.2030	€	287	306	0,13
Summe Irland			6.428	2,79
ISRAEL				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Bank Leumi Le-Israel B.M.				
7,129 % fällig am 18.07.2033 (g)	$	400	396	0,17
STAATSEMISSIONEN				
Israel Government International Bond				
0,150 % fällig am 31.07.2023	ILS	20.800	5.584	2,42
Summe Israel			5.980	2,59
ELFENBEINKÜSTE				
KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG				
Elfenbeinküste				
7,985 % fällig am 19.03.2027	€	800	851	0,37
LUXEMBURG				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Sberbank of Russia Via SB Capital S.A.				
5,250 % fällig am 23.05.2023 ^(g)	$	1.600	$ 96	0,04
Tierra Mojada Luxembourg SARL				
5,750 % fällig am 01.12.2040		0	0	0,00
Summe Luxemburg			96	0,04
MALAYSIA				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Khazanah Capital Ltd.				
4,876 % fällig am 01.06.2033		700	693	0,30
STAATSEMISSIONEN				
Malaysia Government International Bond				
3,800 % fällig am 17.08.2023	MYR	14.600	3.131	1,36
Summe Malaysia			3.824	1,66
MEXIKO				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Metalsa S.A. de C.V.				
3,750 % fällig am 04.05.2031	$	800	631	0,27
Petroleos Mexicanos				
6,375 % fällig am 23.01.2045		1.800	1.107	0,48
Trust Fibra Uno				
6,390 % fällig am 15.01.2050		1.250	990	0,43
			2.728	1,18
STAATSEMISSIONEN				
Mexico Government International Bond				
8,500 % fällig am 18.11.2038	MXN	46.000	2.618	1,14
Summe Mexiko			5.346	2,32
NIEDERLANDE				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
JAB Holdings BV				
4,500 % fällig am 08.04.2052	$	1.500	1.160	0,50
Angola Via Avenir BV				
10,163 % fällig am 07.12.2023		540	537	0,23
12,772 % fällig am 03.07.2023		123	123	0,06
Sagax Euro MTN NL BV				
1,000 % fällig am 17.05.2029	€	1.300	1.012	0,44
Summe Niederlande			2.832	1,23
PANAMA				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Aeropuerto Internacional de Tocumen S.A.				
5,125 % fällig am 11.08.2061	$	600	463	0,20
PARAGUAY				
STAATSEMISSIONEN				
Paraguay Government International Bond				
5,850 % fällig am 21.08.2033 (a)		500	501	0,22
PERU				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Banco de Credito del Peru S.A.				
4,650 % fällig am 17.09.2024	PEN	2.600	688	0,30
STAATSEMISSIONEN				
Peru Government International Bond				
5,940 % fällig am 12.02.2029		700	190	0,08
6,950 % fällig am 12.08.2031		200	56	0,02
7,300 % fällig am 12.08.2033		33.800	9.628	4,18
			9.874	4,28
Summe Peru			10.562	4,58
POLEN				
STAATSEMISSIONEN				
Bank Gospodarstwa Krajowego				
5,375 % fällig am 22.05.2033	$	1.200	1.195	0,52

BESCHREIBUNG		PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
Poland Government International Bond				
0,250 % fällig am 25.10.2026	PLN	33.200	$ 6.864	2,98
2,750 % fällig am 25.04.2028		12.700	2.760	1,20
4,875 % fällig am 04.10.2033	$	1.000	984	0,42
Summe Polen			11.803	5,12
RUMÄNIEN				
STAATSEMISSIONEN				
Romania Government International Bond				
4,250 % fällig am 28.04.2036	RON	3.100	532	0,23
6,625 % fällig am 27.09.2029	€	900	1.022	0,44
Summe Rumänien			1.554	0,67
RUSSLAND				
STAATSEMISSIONEN				
Russia Government International Bond				
1,125 % fällig am 20.11.2027 ^		100	51	0,02
5,100 % fällig am 28.03.2035 ^	$	200	89	0,04
Summe Russland			140	0,06
SERBIEN				
STAATSEMISSIONEN				
Serbia Government International Bond				
4,500 % fällig am 20.08.2032	RSD	13.800	114	0,05
SÜDAFRIKA				
STAATSEMISSIONEN				
South Africa Government International Bond				
6,500 % fällig am 28.02.2041	ZAR	64.900	2.036	0,88
8,000 % fällig am 31.01.2030		49.500	2.316	1,01
10,500 % fällig am 21.12.2026		237.400	13.051	5,66
Summe Südafrika			17.403	7,55
SÜDKOREA				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Mirae Asset Securities Co. Ltd.				
2,625 % fällig am 30.07.2025	$	600	548	0,24
ÜBERNATIONAL				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Africa Finance Corp.				
2,875 % fällig am 28.04.2028		600	496	0,21
SCHWEIZ				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Credit Suisse AG				
4,713 % fällig am 31.05.2024	€	400	435	0,19
TUNESIEN				
STAATSEMISSIONEN				
Banque Centrale de Tunisie Government International Bond				
6,750 % fällig am 31.10.2023		200	203	0,09
TÜRKEI				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Turkish Airlines Pass-Through Trust				
4,200 % fällig am 15.09.2028	$	549	506	0,22
KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG				
SOCAR Turkey Enerji A/S				
6,553 % fällig am 11.08.2026	€	1.400	1.482	0,64
Summe Türkei			1.988	0,86
VEREINIGTE ARABISCHE EMIRATE				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Abu Dhabi National Energy Co. PJSC				
4,696 % fällig am 24.04.2033	$	600	598	0,26
First Abu Dhabi Bank PJSC				
4,774 % fällig am 06.06.2028	$	1.200	$ 1.190	0,52
			1.788	0,78

BESCHREIBUNG		PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
STAATSEMISSIONEN				
Finanzministerium der Regierung von Schardscha				
4,000 % fällig am 28.07.2050		800	514	0,22
Summe Vereinigte Arabische Emirate			2.302	1,00
GROSSBRITANNIEN				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Petra Diamonds U.S. Treasury PLC (6,066 % bar und 3,967 % PIK)				
10,033 % fällig am 08.03.2026 (b)		241	226	0,10
Royalty Pharma PLC				
3,550 % fällig am 02.09.2050		1.500	1.014	0,44
			1.240	0,54
NON-AGENCY-MBS				
Canada Square Funding PLC				
5,316 % fällig am 17.01.2059	£	275	347	0,15
Polaris PLC				
6,154 % fällig am 27.05.2057		46	58	0,02
Rochester Financing PLC				
5,602 % fällig am 18.12.2044		262	330	0,14
Stratton Mortgage Funding PLC				
5,765 % fällig am 12.03.2052		63	80	0,03
Towd Point Mortgage Funding PLC				
5,841 % fällig am 20.07.2045		646	822	0,36
Tower Bridge Funding PLC				
5,629 % fällig am 20.12.2063		174	220	0,10
			1.857	0,80
Summe Großbritannien			3.097	1,34
USA				
FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE				
Aames Mortgage Investment Trust				
6,455 % fällig am 25.06.2035	$	900	793	0,34
ACE Securities Corp. Home Equity Loan Trust				
6,170 % fällig am 25.04.2035		367	352	0,15
Citigroup Mortgage Loan Trust				
5,450 % fällig am 25.10.2036		649	416	0,18
Countrywide Asset-Backed Certificates Trust				
6,125 % fällig am 25.12.2035		297	292	0,13
JPMorgan Mortgage Acquisition Trust				
5,360 % fällig am 25.10.2036		165	163	0,07
5,420 % fällig am 25.07.2036		257	217	0,10
Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust				
6,125 % fällig am 25.07.2034		22	21	0,01
Wells Fargo Home Equity Asset-Backed Securities Trust				
5,470 % fällig am 25.07.2036		900	854	0,37
			3.108	1,35
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Charter Communications Operating LLC				
3,950 % fällig am 30.06.2062		1.700	1.047	0,45
Energy Transfer LP				
6,000 % fällig am 15.06.2048		1.200	1.140	0,50
National Fuel Gas Co.				
2,950 % fällig am 01.03.2031		1.300	1.041	0,45
Pacific Gas & Electric Co.				
4,950 % fällig am 01.07.2050		1.300	1.023	0,44
			4.251	1,84
KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG				
Ecopetrol S.A.				
TBD % fällig am 17.08.2024		1.000	985	0,43
NON-AGENCY-MBS				
IndyMac Mortgage Loan Trust				
5,490 % fällig am 25.11.2036	$	692	$ 672	0,2

BESCHREIBUNG		PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
US-SCHATZOBLIGATIONEN				
U.S. Treasury Bonds				
1,125 % fällig am 15.05.2040		11.900	7.724	3,5
1,750 % fällig am 15.08.2041		16.400	11.534	5,0
2,375 % fällig am 15.02.2042		20.200	15.736	6,8
U.S. Treasury Notes				
2,500 % fällig am 30.04.2024		5.600	5.466	2,3
			40.460	17,5
Summe USA			49.476	21,4
USBEKISTAN				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Ipoteka-Bank ATIB				
5,500 % fällig am 19.11.2025		700	647	0,2
Uzbek Industrial and Construction Bank ATB				
5,750 % fällig am 02.12.2024		700	667	0,2
Summe Usbekistan			1.314	0,5
SAMBIA				
STAATSEMISSIONEN				
Zambia Government International Bond				
13,000 % fällig am 25.01.2031	ZMW	25.900	871	0,3
KURZFRISTIGE INSTRUMENTE				
HUNGARY TREASURY BILLS				
16,220 % fällig am 06.07.2023 (c)(d)	HUF	2.976.000	8.687	3,7
JAPAN TREASURY BILLS				
(0,206) % fällig am 18.07.2023 (c)(d)	¥	2.137.000	14.786	6,4
(0,188) % fällig am 18.07.2023 (c)(d)		1.007.000	6.968	3,0
(0,183) % fällig am 10.07.2023 (c)(d)		505.000	3.494	1,5
(0,183) % fällig am 21.08.2023 (c)(d)		1.470.000	10.172	4,4
			35.420	15,3
Summe kurzfristige Instrumente			44.107	19,1
Summe Übertragbare Wertpapiere			**$ 205.639**	**89,1**
		AKTIEN		
INVESTMENTFONDS				
ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN				
PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (f)		1.204.286	11.992	5,2
BÖRSENGEHANDELTE FONDS				
PIMCO ETFs plc - PIMCO US Dollar Short Maturity UCITS ETF (f)		6.300	626	0,2
Summe Investmentfonds			**$ 12.618**	**5,4**

PENSIONSGESCHÄFTE

Kontrahent	Kredit-zins	Abrechnungs-datum	Fälligkeits-datum	Kapital-betrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensions-geschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensions-geschäft[1]	% des Nettovermögens
SSB	2,400 %	30.06.2023	03.07.2023	$ 939	U.S. Treasury Notes 1,875 % fällig am 30.06.2026	$ (958)	$ 939	$ 939	0,41
Summe Pensionsgeschäfte						**$ (958)**	**$ 939**	**$ 939**	**0,41**

[1] Umfasst aufgelaufene Zinsen.

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

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

FUTURES

Beschreibung	Art	Ablauf-monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
3-Month SOFR June Futures	Short	09.2023	2	$ 1	0,00
Euro-Bund 10-Year Bond September Futures	Long	09.2023	47	(29)	(0,01)
U.S. Treasury 5-Year Note September Futures	Long	09.2023	554	(1.102)	(0,48)
U.S. Treasury 10-Year Note September Futures	Short	09.2023	18	37	0,01
U.S. Treasury 10-Year Ultra September Futures	Short	09.2023	1	1	0,00
U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond September Futures	Short	09.2023	75	(123)	(0,05)
				$ (1.215)	(0,53)
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate				**$ (1.215)**	**(0,53)**

ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)

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

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMMISSIONEN - SCHUTZVERKAUF[1]

Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag[2]	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Newell Brands, Inc.	1,000 %	20.06.2028	$ 700	$ 5	0,00

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES - SCHUTZVERKAUF[1]

Index/Tranchen	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag[2]	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
CDX.EM-39 5-Year Index	1,000 %	20.06.2028	$ 23.900	$ 439	0,19
CDX.IG-40 5-Year Index	1,000	20.06.2028	22.200	155	0,07
				$ 594	0,26

ZINSSWAPS

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Erhalt[3]	1-Day INR-MIBOR Compounded-OIS	6,000 %	20.09.2028	INR 1.577.940	$ 77	0,03
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	0,000	16.09.2023	$ 9.300	(133)	(0,06)
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	0,750	16.06.2031	2.500	363	0,16
Zahlung[3]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,000	16.12.2025	7.900	(846)	(0,37)
Zahlung[3]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,250	17.06.2025	400	(35)	(0,02)
Zahlung[3]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,250	17.06.2030	3.070	(573)	(0,25)
Erhalt[3]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,250	16.12.2050	1.500	594	0,26
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,250	16.06.2051	6.800	1.467	0,64
Erhalt[3]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,250	16.06.2051	4.500	920	0,40
Zahlung[3]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,500	21.06.2024	7.100	(117)	(0,05)
Erhalt[3]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,500	18.12.2024	270	15	0,01
Erhalt[3]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,500	18.12.2029	4.100	447	0,19
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,562	14.02.2024	22.300	811	0,35
Erhalt[3]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,750	15.12.2031	2.700	440	0,19

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits-datum		Nenn-betrag		Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Zahlung	1-Year BRL-CDI	5,580 %	02.01.2025	BRL	10.000	$	(261)	(0,11)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	6,220	02.01.2025		4.600		(89)	(0,04)
Erhalt	1-Year BRL-CDI	6,745	02.01.2025		10.500		143	0,06
Zahlung	1-Year BRL-CDI	6,950	04.01.2027		8.300		(148)	(0,06)
Erhalt	1-Year BRL-CDI	8,570	04.01.2027		11.900		167	0,07
Zahlung	1-Year BRL-CDI	8,615	02.01.2025		6.000		(25)	(0,01)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	10,120	04.01.2027		2.500		(13)	(0,01)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	10,206	04.01.2027		9.400		(43)	(0,02)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	10,446	04.01.2027		28.200		(79)	(0,03)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	10,565	04.01.2027		45.800		60	0,03
Zahlung	1-Year BRL-CDI	10,665	02.01.2024		5.800		(44)	(0,02)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	10,755	02.01.2024		22.000		(159)	(0,07)
Erhalt	1-Year BRL-CDI	10,800	02.01.2024		51.900		363	0,16
Zahlung	1-Year BRL-CDI	10,833	02.01.2024		31.800		(221)	(0,10)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	10,995	02.01.2024		15.300		(96)	(0,04)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,055	04.01.2027		22.200		16	0,01
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,065	02.01.2024		10.600		(63)	(0,03)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,148	02.01.2024		2.600		(15)	(0,01)
Erhalt	1-Year BRL-CDI	11,170	04.01.2027		24.800		(43)	(0,02)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,400	04.01.2027		15.500		92	0,04
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,410	04.01.2027		15.500		93	0,04
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,420	02.01.2026		38.300		174	0,07
Erhalt	1-Year BRL-CDI	11,810	02.01.2025		65.900		(93)	(0,04)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,890	02.01.2025		88.400		36	0,02
Erhalt	1-Year BRL-CDI	11,905	04.01.2027		37.800		(312)	(0,14)
Erhalt	1-Year BRL-CDI	11,920	02.01.2024		99.100		377	0,16
Zahlung	1-Year BRL-CDI	12,005	02.01.2025		22.100		15	0,01
Erhalt	1-Year BRL-CDI	12,090	04.01.2027		25.200		(73)	(0,03)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	12,091	04.01.2027		21.700		195	0,08
Zahlung	1-Year BRL-CDI	12,210	02.01.2025		15.500		23	0,01
Zahlung	1-Year BRL-CDI	12,290	02.01.2024		54.800		(203)	(0,09)
Erhalt	1-Year BRL-CDI	12,350	01.07.2024		52.300		(27)	(0,01)
Erhalt	1-Year BRL-CDI	12,490	01.07.2024		56.100		(44)	(0,02)
Erhalt	1-Year BRL-CDI	12,533	02.01.2029		16.000		(209)	(0,09)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	12,595	01.07.2024		46.000		51	0,02
Zahlung	1-Year BRL-CDI	12,684	02.01.2029		19.000		264	0,11
Zahlung	1-Year BRL-CDI	12,746	02.01.2029		20.500		292	0,13
Zahlung	1-Year BRL-CDI	12,940	04.01.2027		27.000		345	0,15
Zahlung	1-Year BRL-CDI	13,080	01.07.2024		100.300		198	0,09
Erhalt	1-Year BRL-CDI	13,218	02.01.2029		39.300		(664)	(0,29)
Erhalt	3-Month CNY-CNREPOFIX	2,500	16.03.2027	CNY	35.200		(50)	(0,02)
Zahlung	3-Month CNY-CNREPOFIX	2,500	15.03.2028		71.500		14	0,01
Zahlung	3-Month CNY-CNREPOFIX	2,750	21.06.2028		101.900		17	0,01
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	2,690	24.07.2024	COP	7.257.000		175	0,08
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	2,740	24.07.2024		7.084.900		(169)	(0,07)
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	3,100	26.11.2025		2.651.000		81	0,04
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	4,060	26.11.2025		14.071.000		360	0,16
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	4,110	23.03.2026		4.493.200		(101)	(0,04)
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	4,651	26.11.2025		2.624.800		(59)	(0,03)
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	5,050	16.07.2026		34.330.400		(810)	(0,35)
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	6,130	26.10.2026		25.320.800		405	0,18
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	6,885	31.01.2025		24.609.000		311	0,13
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	7,080	02.02.2027		1.622.900		14	0,01
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	7,090	28.04.2028		1.750.200		9	0,00
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	7,130	31.01.2027		8.865.000		74	0,03
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	7,130	28.04.2028		618.500		4	0,00
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	7,140	28.04.2028		1.855.800		12	0,01
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	8,320	31.03.2027		2.908.000		9	0,00
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	8,560	30.03.2027		4.424.200		22	0,01
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	8,686	30.03.2027		26.334.600		154	0,07
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	8,830	31.03.2028		4.898.000		(54)	(0,02)
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	8,940	24.03.2030		11.638.000		(216)	(0,09)
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	9,140	28.04.2028		3.977.000		51	0,02
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	9,520	15.03.2028		35.000.000		592	0,26
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	9,800	17.01.2028		9.809.000		172	0,07
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	10,265	12.04.2025		41.439.000		(73)	(0,03)
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	11,640	21.10.2025		11.114.000		(149)	(0,06)
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	11,930	10.11.2025		5.929.100		92	0,04
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	12,000	26.11.2025		427.000		(7)	0,00
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	12,060	09.11.2025		4.198.000		68	0,03
Zahlung	3-Month KRW-KORIBOR	3,250	15.03.2033	KRW	13.900.100		(97)	(0,04)
Zahlung	3-Month THB-THORON Compounded-OIS	2,250	15.03.2028	THB	234.710		(67)	(0,03)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	0,000	16.09.2023	$	9.300		134	0,06
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,000	16.09.2023		7.900		(93)	(0,04)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,250	16.09.2023		6.000		66	0,03
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,250	17.09.2023		3.470		(37)	(0,02)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,500	18.09.2023		4.370		44	0,02
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,500	21.09.2023		7.100		(73)	(0,03)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,750	15.09.2023		2.700		26	0,01
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	5,757	14.04.2026	ZAR	96.300		(360)	(0,16)
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	0,905	24.11.2023	CLP	1.293.300		73	0,03

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits-datum		Nenn-betrag		Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	1,070 %	10.12.2023	CLP	1.218.000	$	(65)	(0,03)
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	1,080	10.12.2023		1.218.000		(64)	(0,03)
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	1,090	10.12.2023		2.828.000		(158)	(0,07)
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	1,345	11.06.2025		1.350.000		167	0,07
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	1,947	23.11.2027		999.000		176	0,08
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	1,950	05.05.2026		1.239.600		(180)	(0,08)
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	1,965	24.11.2027		851.000		147	0,06
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	2,020	30.04.2026		1.300.000		(188)	(0,08)
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	2,183	04.12.2027		2.661.000		(436)	(0,19)
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	2,360	22.01.2025		1.099.200		(149)	(0,06)
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	2,640	01.03.2026		795.000		110	0,05
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	3,530	06.07.2026		1.995.000		250	0,11
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	4,000	06.07.2028		1.019.000		111	0,05
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	5,130	01.03.2025		1.820.000		115	0,05
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	5,180	01.10.2028		790.000		17	0,01
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	5,240	01.09.2030		1.286.000		15	0,01
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	5,260	01.03.2026		620.000		27	0,01
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	5,360	27.03.2028		1.914.900		31	0,01
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	5,370	01.10.2028		3.136.000		30	0,01
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	5,470	01.09.2030		460.000		(4)	0,00
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	5,548	10.04.2028		833.000		(2)	0,00
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	5,570	01.10.2028		245.000		(5)	0,00
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	5,589	10.04.2028		1.694.000		(1)	0,00
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	5,600	12.12.2027		1.803.000		(16)	(0,01)
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	5,635	12.12.2027		3.695.000		(39)	(0,02)
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	5,700	17.05.2028		1.602.100		(23)	(0,01)
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	5,720	28.01.2025		4.012.000		225	0,10
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	5,734	18.05.2028		9.093.000		(150)	(0,07)
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	5,754	28.01.2025		3.238.000		175	0,08
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	5,760	28.01.2025		1.933.000		104	0,04
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	5,915	01.02.2025		3.534.300		181	0,08
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	6,020	02.03.2029		190.000		8	0,00
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	6,070	28.02.2028		3.391.700		(60)	(0,03)
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	6,194	10.03.2028		1.681.200		47	0,02
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	6,223	13.03.2028		680.300		23	0,01
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	6,255	13.03.2028		478.200		15	0,01
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	6,270	02.03.2027		415.700		7	0,00
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	6,330	09.03.2028		526.800		19	0,01
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	6,360	25.05.2027		24.600		2	0,00
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	6,386	24.05.2027		1.861.000		59	0,03
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	6,440	07.03.2028		1.344.000		53	0,02
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	6,500	12.12.2025		2.564.000		(19)	(0,01)
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	6,535	09.01.2026		9.540.000		(163)	(0,07)
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	6,567	12.12.2025		1.464.000		(12)	(0,01)
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	6,570	22.12.2025		1.277.000		(18)	(0,01)
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	6,590	22.12.2025		3.565.000		(40)	(0,02)
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	6,590	21.03.2027		4.540.300		49	0,02
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	6,805	06.03.2027		1.852.000		63	0,03
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	7,000	27.09.2032		1.785.800		301	0,13
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	7,265	07.03.2026		262.400		9	0,00
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	7,270	07.03.2026		2.463.000		57	0,02
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	7,370	06.03.2026		1.686.000		42	0,02
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	7,690	10.05.2025		7.125.500		7	0,00
Zahlung[3]	6-Month CZK-PRIBOR	1,025	29.07.2030	CZK	35.800		(171)	(0,07)
Zahlung	6-Month CZK-PRIBOR	1,224	28.01.2031		44.500		(439)	(0,19)
Zahlung	6-Month CZK-PRIBOR	1,575	26.03.2026		28.100		(136)	(0,06)
Zahlung	6-Month CZK-PRIBOR	1,725	22.07.2026		23.800		(118)	(0,05)
Erhalt	6-Month CZK-PRIBOR	1,815	28.01.2031		34.200		276	0,12
Zahlung	6-Month CZK-PRIBOR	2,000	19.06.2024		26.100		(68)	(0,03)
Erhalt	6-Month CZK-PRIBOR	3,490	18.01.2032		10.600		32	0,01
Erhalt	6-Month CZK-PRIBOR	3,680	03.03.2027		78.400		135	0,06
Erhalt	6-Month CZK-PRIBOR	4,164	14.03.2027		73.600		105	0,05
Erhalt	6-Month CZK-PRIBOR	4,220	14.03.2027		73.500		98	0,04
Zahlung	6-Month CZK-PRIBOR	4,300	18.03.2027		143.400		(140)	(0,06)
Erhalt	6-Month CZK-PRIBOR	4,310	15.03.2027		19.100		22	0,01
Erhalt	6-Month CZK-PRIBOR	4,320	15.03.2027		7.200		8	0,00
Erhalt	6-Month CZK-PRIBOR	4,560	14.07.2032		111.300		(112)	(0,05)
Zahlung	6-Month CZK-PRIBOR	4,611	06.06.2028		248.000		(80)	(0,03)
Zahlung	6-Month CZK-PRIBOR	4,640	18.05.2028		64.400		7	0,00
Zahlung	6-Month CZK-PRIBOR	4,740	28.02.2033		91.700		160	0,07
Zahlung	6-Month CZK-PRIBOR	5,040	17.04.2028		27.900		22	0,01
Zahlung	6-Month CZK-PRIBOR	5,100	18.04.2028		11.800		11	0,00
Erhalt	6-Month CZK-PRIBOR	5,110	22.03.2026		72.500		30	0,01
Erhalt	6-Month CZK-PRIBOR	5,125	22.03.2026		50.000		20	0,01
Zahlung	6-Month CZK-PRIBOR	5,480	15.03.2026		216.500		4	0,00
Zahlung	6-Month CZK-PRIBOR	5,606	28.06.2027		54.800		80	0,03
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	0,550	15.12.2040	€	300		141	0,06
Erhalt[3]	6-Month EUR-EURIBOR	2,500	20.09.2053		600		16	0,01
Erhalt[3]	6-Month EUR-EURIBOR	3,000	20.09.2028		1.500		(5)	0,00
Zahlung	6-Month HUF-BBR	1,500	19.06.2024	HUF	1.427.600		(480)	(0,21)
Erhalt	6-Month HUF-BBR	1,760	21.01.2030		380.000		372	0,16

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits-datum		Nenn-betrag		Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Zahlung	6-Month HUF-BBR	1,958 %	19.03.2026	HUF	398.600	$	(239)	(0,10)
Erhalt	6-Month HUF-BBR	5,500	04.03.2027		2.382.600		804	0,35
Zahlung	6-Month HUF-BBR	6,280	18.03.2027		2.363.300		(556)	(0,24)
Erhalt	6-Month HUF-BBR	13,600	12.12.2024		1.418.700		(353)	(0,15)
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR	1,110	12.01.2031	PLN	9.800		640	0,28
Zahlung	6-Month PLN-WIBOR	1,165	28.01.2031		4.400		(131)	(0,06)
Erhalt[3]	6-Month PLN-WIBOR	1,215	29.07.2030		10.300		338	0,15
Zahlung	6-Month PLN-WIBOR	1,855	28.01.2031		6.000		(316)	(0,14)
Zahlung	6-Month PLN-WIBOR	1,933	17.01.2025		11.800		(289)	(0,13)
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR	2,635	28.10.2026		32.900		(244)	(0,11)
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR	3,035	09.12.2026		42.000		560	0,24
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR	4,075	07.03.2027		28.700		277	0,12
Zahlung	6-Month PLN-WIBOR	4,830	18.03.2027		28.300		(48)	(0,02)
Zahlung	6-Month PLN-WIBOR	4,895	17.03.2027		15.000		(54)	(0,02)
Zahlung	6-Month PLN-WIBOR	4,920	17.03.2027		15.000		(51)	(0,02)
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR	6,300	25.04.2028		11.900		(54)	(0,02)
Zahlung	6-Month PLN-WIBOR	6,670	28.06.2027		14.400		194	0,08
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR	6,725	27.06.2027		20.700		(289)	(0,13)
Zahlung	6-Month PLN-WIBOR	6,843	28.06.2027		1.500		22	0,01
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR	7,310	30.06.2027		11.000		(210)	(0,09)
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	5,080	16.06.2025	MXN	16.400		(82)	(0,04)
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	5,700	12.09.2030		35.400		(271)	(0,12)
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	5,770	09.10.2030		150.700		1.127	0,49
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	5,850	19.08.2030		12.100		(89)	(0,04)
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	5,875	16.08.2030		16.800		(119)	(0,05)
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	5,880	16.08.2030		8.700		(61)	(0,03)
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	5,920	16.08.2030		9.100		(63)	(0,03)
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	6,240	10.07.2026		113.600		(441)	(0,19)
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	6,480	28.05.2040		16.700		(34)	(0,01)
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	6,495	17.07.2026		140.500		541	0,23
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	6,505	17.07.2026		102.100		392	0,17
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	6,580	01.01.2025		29.700		(93)	(0,04)
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	6,830	27.12.2029		19.900		(77)	(0,03)
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	7,570	19.11.2026		145.200		(463)	(0,20)
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	7,675	04.06.2029		65.100		(103)	(0,05)
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	8,465	16.08.2027		167.300		22	0,01
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	8,480	24.03.2027		121.900		(74)	(0,03)
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	8,560	18.05.2028		14.500		(6)	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	8,585	18.05.2028		14.700		(7)	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	8,600	18.05.2028		7.400		(4)	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	8,610	18.05.2028		7.600		(4)	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	8,645	18.05.2028		7.600		(5)	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	8,656	18.05.2028		17.300		(12)	(0,01)
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	8,700	05.11.2027		8.700		4	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	8,740	07.03.2028		192.900		(194)	(0,08)
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	8,743	05.11.2027		37.900		21	0,01
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	8,760	05.11.2027		25.400		15	0,01
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	8,773	05.11.2027		20.000		12	0,01
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	9,045	04.11.2027		17.200		20	0,01
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	9,053	04.11.2027		18.900		23	0,01
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	9,117	04.11.2027		47.100		63	0,03
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	9,165	05.11.2026		25.600		15	0,01
						$	4.668	2,02
Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate						**$**	**5.267**	**2,28**

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

(2) Der maximal mögliche Betrag, den der Fonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

(3) Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft.

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

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

OPTIONSKAUF

DEVISENOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung		Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag[1]		Kosten		Markt-wert	% des Nettovermögens
BOA	Put - OTC EUR versus CZK	CZK	23,830	01.11.2023	802	$	84	$	356	0,15
GLM	Put - OTC EUR versus HUF	HUF	385,000	01.11.2023	203		27		123	0,05
	Put - OTC EUR versus PLN	PLN	4,560	01.11.2023	403		48		317	0,14
JPM	Put - OTC EUR versus HUF	HUF	385,000	01.11.2023	403		39		243	0,11
MYI	Put - OTC USD versus MXN	MXN	18,500	25.07.2023	4.228		106		313	0,14
UAG	Call - OTC USD versus ZAR	ZAR	20,500	09.10.2023	6.748		94		68	0,03
						$	398	$	1.420	0,62

STRADDLE-OPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungskurs[2]	Verfallsdatum	Nennbetrag[1]	Kosten[2]	Marktwert	% des Nettovermögens
BOA	Call & Put - OTC 6-Month vs. 6-Month Forward Volatility Agreement	12,600 %	27.12.2023	2.800	$ 0	$ 1	0,00
	Call & Put - OTC 6-Month vs. 6-Month Forward Volatility Agreement	15,050	27.12.2023	2.800	0	3	0,00
CBK	Call & Put - OTC 6-Month vs. 6-Month Forward Volatility Agreement	15,100	20.12.2023	8.800	0	1	0,00
	Call & Put - OTC 6-Month vs. 6-Month Forward Volatility Agreement	12,600	29.12.2023	2.600	0	0	0,00
MYI	Call & Put - OTC 6-Month vs. 6-Month Forward Volatility Agreement	12,600	27.12.2023	3.900	0	1	0,00
					$ 0	$ 6	0,00

VERKAUFSOPTIONEN

DEVISENOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungskurs	Verfallsdatum	Nennbetrag[1]	Aufgeld	Marktwert	% des Nettovermögens
MYI	Call - OTC USD versus CLP	CLP 850,000	18.07.2023	2.436	$ (34)	$ (3)	0,00
	Put - OTC USD versus MXN	MXN 17,750	25.07.2023	8.456	(54)	(275)	(0,12)
	Call - OTC USD versus MXN	21,000	07.03.2024	4.072	(91)	(29)	(0,01)
					$ (179)	$ (307)	(0,13)

(1) Der Nennbetrag stellt die Anzahl der Kontrakte dar.

(2) Ausübungskurs und endgültige Kosten werden zu einem zukünftigen Zeitpunkt auf der Basis impliziter Volatilitätsparameter festgelegt.

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMMISSIONEN - SCHUTZKAUF[1]

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu bezahlender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag[3]	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Marktwert	% des Nettovermögens
BOA	Brazil Government International Bond	(1,000) %	20.12.2024	$ 1.800	$ 27	$ (43)	$ (16)	(0,01)
	Turkey Government International Bond	(1,000)	20.06.2024	400	24	(16)	8	0,01
BPS	Turkey Government International Bond	(1,000)	20.06.2024	1.400	65	(38)	27	0,01
BRC	Brazil Government International Bond	(1,000)	20.12.2024	1.000	16	(25)	(9)	0,00
CBK	Mexico Government International Bond	(1,000)	20.12.2024	100	(1)	0	(1)	0,00
	Turkey Government International Bond	(1,000)	20.12.2024	200	12	(4)	8	0,00
GST	Mexico Government International Bond	(1,000)	20.12.2024	2.000	(23)	2	(21)	(0,01)
	Turkey Government International Bond	(1,000)	20.06.2024	6.500	304	(176)	128	0,06
HUS	Mexico Government International Bond	(1,000)	20.12.2024	1.100	(13)	1	(12)	(0,01)
JPM	Brazil Government International Bond	(1,000)	20.12.2024	3.200	63	(91)	(28)	(0,01)
					$ 474	$ (390)	$ 84	0,04

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMMISSIONEN - SCHUTZVERKAUF[2]

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag[3]	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Marktwert	% des Nettovermögens
BPS	South Africa Government International Bond	1,000 %	20.12.2023	$ 200	$ 0	$ 0	$ 0	0,00
BRC	Colombia Government International Bond	1,000	20.12.2027	1.200	(84)	31	(53)	(0,02)
GST	Poland Government International Bond	1,000	20.06.2024	400	2	1	3	0,00
JPM	Banco do Brasil S.A.	1,000	20.12.2024	600	(14)	9	(5)	0,00
					$ (96)	$ 41	$ (55)	(0,02)

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

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

(3) Der maximal mögliche Betrag, den der Fonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

CROSS-CURRENCY SWAPS

Kontrahent	Erhalt	Zahlung	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag erhaltener Währung	Nennbetrag gelieferter Währung	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Marktwert	% des Nettovermögens
BOA	Variabler Zinssatz entspricht 3-Month INR-LIBOR zzgl. 0,672 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung	Variabler Zinssatz entspricht 3-Month USD-LIBOR basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung	20.09.2028	INR 177.590	$ 2.160	$ 4	$ 2	$ 6	0,00

Kontrahent	Erhalt	Zahlung	Fälligkeits-datum	Nennbetrag erhaltener Währung	Nennbetrag gelieferter Währung	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Markt-wert	% des Nettovermögens
GLM	Variabler Zinssatz entspricht 6-Month USD-LIBOR zzgl. 0,282 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung	Variabler Zinssatz entspricht 6-Month ARS-LIBOR basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung	07.06.2027	$ 100	ARS 4.488	$ 0	$ 97	$ 97	0,04
	Variabler Zinssatz entspricht 3-Month INR-LIBOR zzgl. 0,664 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung	Variabler Zinssatz entspricht 3-Month USD-LIBOR basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung	20.09.2028	INR 709.400	$ 8.637	4	(23)	(19)	(0,01)
JPM	Variabler Zinssatz entspricht 3-Month INR-LIBOR zzgl. 0,672 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung	Variabler Zinssatz entspricht 3-Month USD-LIBOR basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung	20.09.2028	180.040	2.190	4	2	6	0,00
SCX	Variabler Zinssatz entspricht 3-Month INR-LIBOR zzgl. 0,664 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung	Variabler Zinssatz entspricht 3-Month USD-LIBOR basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung	20.09.2028	438.090	5.338	5	(14)	(9)	0,00
						$ 17	$ 64	$ 81	0,03

ZINSSWAPS

Kontrahent	Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Markt-wert	% des Nettovermögens
BOA	Zahlung	3-Month MYR-KLIBOR	3,750 %	15.06.2027	MYR 21.600	$ (38)	$ 57	$ 19	0,01
BPS	Zahlung	3-Month MYR-KLIBOR	2,670	16.06.2026	10.600	0	(62)	(62)	(0,03)
JPM	Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	3,020	06.06.2024	CLP 770.000	0	(55)	(55)	(0,02)
MYC	Erhalt	3-Month MYR-KLIBOR	3,000	15.12.2026	MYR 13.400	3	58	61	0,03
MYI	Zahlung	3-Month MYR-KLIBOR	3,340	18.09.2029	3.500	0	(17)	(17)	(0,01)
SCX	Zahlung	3-Month CNY-CNREPOFIX	2,430	06.03.2025	CNY 25.600	0	23	23	0,01
	Zahlung	3-Month CNY-CNREPOFIX	3,020	04.02.2025	26.000	0	41	41	0,02
	Zahlung	3-Month MYR-KLIBOR	2,750	15.09.2026	MYR 3.700	11	(33)	(22)	(0,01)
	Erhalt	3-Month MYR-KLIBOR	3,230	23.08.2024	6.500	0	7	7	0,00
UAG	Zahlung	3-Month CNY-CNREPOFIX	2,920	15.01.2025	CNY 43.900	0	90	90	0,04
						$ (24)	$ 109	$ 85	0,04

DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2023	DKK 1.623	$ 234	$ 0	$ (3)	$ (3)	0,00
	07.2023	INR 368.549	4.581	94	0	94	0,04
	07.2023	KES 81.859	578	0	(1)	(1)	0,00
	07.2023	MXN 165.028	8.964	0	(634)	(634)	(0,28)
	07.2023	PLN 1.742	418	0	(11)	(11)	0,00
	07.2023	$ 433	DKK 2.943	0	(2)	(2)	0,00
	07.2023	4.572	INR 368.549	0	(85)	(85)	(0,04)
	07.2023	199	PLN 823	3	0	3	0,00
	08.2023	AUD 308	$ 208	3	0	3	0,00
	08.2023	DKK 2.939	433	2	0	2	0,00
	08.2023	€ 992	1.065	0	(20)	(20)	(0,01)
	08.2023	¥ 291.300	2.108	80	0	80	0,03
	08.2023	MXN 19.292	1.044	0	(73)	(73)	(0,03)
	08.2023	$ 1.061	CNY 7.281	0	(54)	(54)	(0,02)
	08.2023	142	EGP 4.728	6	0	6	0,00
	08.2023	1.528	€ 1.406	9	0	9	0,00
	08.2023	ZAR 108.235	$ 5.782	75	0	75	0,03
	09.2023	KRW 4.273	3	0	0	0	0,00
	09.2023	NGN 56.791	98	26	0	26	0,01
	09.2023	PEN 17.182	4.685	0	(27)	(27)	(0,01)
	09.2023	TWD 22.335	736	17	0	17	0,01
	09.2023	$ 10	NGN 7.760	0	0	0	0,00
	09.2023	4.439	PEN 16.471	78	0	78	0,03
	10.2023	114	KES 17.190	4	0	4	0,00
	10.2023	ZAR 17.796	$ 959	26	0	26	0,01
BPS	07.2023	CZK 63.184	2.937	38	0	38	0,02
	07.2023	PHP 5.138	91	0	(2)	(2)	0,00
	07.2023	PLN 468	113	0	(2)	(2)	0,00
	07.2023	$ 3.038	MYR 13.943	0	(45)	(45)	(0,02)
	07.2023	22	PLN 91	0	0	0	0,00

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung		Zu erhaltende Währung		Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
	08.2023	CNH	13.452	$	1.955	$ 99	$ 0	$ 99	0,04
	08.2023	MYR	14.815		3.189	5	0	5	0,00
	08.2023	TWD	11.180		366	7	0	7	0,00
	08.2023	$	2.372	CNY	16.273	0	(121)	(121)	(0,05)
	08.2023		1.208	COP	5.426.193	80	0	80	0,03
	08.2023		2.294	€	2.092	0	(7)	(7)	0,00
	08.2023	ZAR	621	$	33	1	0	1	0,00
	09.2023	PEN	11.310		3.090	0	(11)	(11)	0,00
	09.2023	$	91	PHP	5.138	2	0	2	0,00
	09.2023		0	THB	9	0	0	0	0,00
	10.2023		1.387	ZAR	27.192	37	0	37	0,02
	10.2023	ZAR	39.034	$	2.099	54	0	54	0,02
	12.2023	NGN	14.580		18	0	0	0	0,00
	12.2023	$	4.502	MXN	80.258	39	0	39	0,02
BRC	07.2023	BRL	11.242	$	2.343	13	0	13	0,01
	07.2023	¥	3.144.000		24.308	2.513	0	2.513	1,09
	07.2023	$	2.317	MYR	10.643	0	(32)	(32)	(0,01)
	08.2023	COP	5.597.988	$	1.314	0	(10)	(10)	0,00
	08.2023	$	2.024	£	1.612	27	0	27	0,01
	08.2023		283	¥	37.513	0	(22)	(22)	(0,01)
	08.2023	ZAR	129.385	$	6.550	1	(270)	(269)	(0,12)
	09.2023	ILS	2.436		681	23	0	23	0,01
	09.2023	$	1.804	MXN	31.492	6	0	6	0,00
	10.2023	MXN	70.947	$	3.787	0	(270)	(270)	(0,12)
CBK	07.2023	CLP	13.318.245		16.456	0	(128)	(128)	(0,06)
	07.2023	CZK	55.760		2.588	29	0	29	0,01
	07.2023	ILS	20.381		5.868	372	0	372	0,16
	07.2023	MXN	43.942		2.529	0	(29)	(29)	(0,01)
	07.2023	PLN	9.114		2.181	0	(60)	(60)	(0,03)
	07.2023	$	1.215	BRL	5.833	0	(6)	(6)	0,00
	07.2023		591	COP	2.696.780	51	0	51	0,02
	07.2023		94	PHP	5.138	0	(1)	(1)	0,00
	07.2023		34	PLN	137	0	0	0	0,00
	07.2023		4.157	RON	18.796	0	(24)	(24)	(0,01)
	07.2023		209	UYU	8.254	12	0	12	0,01
	07.2023	UYU	8.254	$	220	0	(1)	(1)	0,00
	08.2023	BRL	6.565		1.270	0	(84)	(84)	(0,04)
	08.2023	CAD	31		23	0	0	0	0,00
	08.2023	CLP	1.097.369		1.325	0	(39)	(39)	(0,02)
	08.2023	CNY	6.135		890	42	0	42	0,02
	08.2023	COP	1.959.460		463	0	0	0	0,00
	08.2023	EGP	11.401		329	0	(29)	(29)	(0,01)
	08.2023	€	1.582		1.700	0	(30)	(30)	(0,01)
	08.2023	PEN	7.977		2.042	0	(151)	(151)	(0,07)
	08.2023	TWD	11.639		381	7	0	7	0,00
	08.2023	$	9.726	CLP	7.958.093	123	0	123	0,05
	08.2023		216	CNH	1.509	0	(8)	(8)	0,00
	08.2023		1.419	€	1.295	0	(4)	(4)	0,00
	08.2023		333	£	263	2	0	2	0,00
	09.2023	COP	413.251	$	98	1	0	1	0,00
	09.2023	KRW	8.866		7	0	0	0	0,00
	09.2023	MXN	39.108		2.099	0	(146)	(146)	(0,06)
	09.2023	PHP	111.257		1.975	0	(33)	(33)	(0,01)
	09.2023	$	7.443	IDR	111.078.693	0	(65)	(65)	(0,03)
	09.2023		4.199	INR	348.032	31	0	31	0,01
	09.2023	ZMW	14.094	$	803	16	0	16	0,01
	10.2023	$	97	NGN	58.212	0	(25)	(25)	(0,01)
	02.2024	EGP	6.270	$	167	0	(1)	(1)	0,00
	02.2024	$	409	EGP	14.313	0	(26)	(26)	(0,01)
DUB	07.2023	$	700	KES	101.607	19	0	19	0,01
	10.2023		252	NGN	149.289	0	(66)	(66)	(0,03)
	10.2023	ZAR	13.689	$	752	35	0	35	0,02
	02.2024	$	2.218	EGP	77.705	0	(134)	(134)	(0,06)
FAR	10.2023		3.047	ZAR	59.715	81	0	81	0,04
GLM	07.2023	BRL	35.370	$	7.082	0	(250)	(250)	(0,11)
	07.2023	DOP	215.614		3.725	0	(132)	(132)	(0,06)
	07.2023	RON	756		168	1	0	1	0,00
	07.2023	$	7.897	BRL	40.783	568	(11)	557	0,24
	07.2023		104	MXN	1.803	1	0	1	0,00
	07.2023		202	PLN	856	8	0	8	0,00
	07.2023		159	RON	719	0	(1)	(1)	0,00
	08.2023	BRL	5.517	$	1.149	11	0	11	0,00
	08.2023	DOP	89.524		1.555	0	(51)	(51)	(0,02)
	08.2023	$	1.699	CHF	1.504	0	(11)	(11)	0,00
	08.2023	ZAR	44.848	$	2.417	52	0	52	0,02
	09.2023	$	4.973	BRL	24.276	4	0	4	0,00
	09.2023		4.688	THB	161.733	0	(92)	(92)	(0,04)
	09.2023		2.005	TWD	61.018	0	(42)	(42)	(0,02)
	10.2023	DOP	81.364	$	1.450	7	0	7	0,00
	10.2023	NGN	287.412		513	156	0	156	0,07
	10.2023	ZAR	34.001		1.812	32	0	32	0,01
	11.2023	€	3.075	PLN	13.819	5	0	5	0,00

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung		Zu erhaltende Währung		Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
IND	07.2023	DKK	4.770	$	689	$ 0	$ (10)	$ (10)	(0,00)
	11.2023	€	443	HUF	205.188	98	0	98	0,04
	06.2024	$	815	TWD	20.969	0	(122)	(122)	(0,05)
JPM	07.2023		4.382	MXN	77.122	107	0	107	0,05
	07.2023		75	NGN	41.102	0	(22)	(22)	(0,01)
	07.2023		49	PLN	207	2	0	2	0,00
	07.2023		78	SGD	103	0	(2)	(2)	0,00
	08.2023	BRL	21.667	$	4.228	0	(242)	(242)	(0,11)
	08.2023	CAD	51		38	0	0	0	0,00
	08.2023	CNH	3.945		571	27	0	27	0,01
	08.2023	COP	1.102.429		260	0	(2)	(2)	0,00
	08.2023	£	2.412		3.055	0	(12)	(12)	(0,01)
	08.2023	HUF	1.006.288		2.883	1	(25)	(24)	(0,01)
	08.2023	$	2.560	CHF	2.251	0	(33)	(33)	(0,01)
	08.2023		1.321	CNY	9.032	0	(71)	(71)	(0,03)
	08.2023		199	EGP	6.673	10	0	10	0,00
	08.2023		5.951	€	5.434	0	(10)	(10)	0,00
	08.2023		46	¥	6.165	0	(3)	(3)	0,00
	08.2023		2.064	MXN	35.765	4	0	4	0,00
	08.2023		2.564	ZAR	49.713	67	(11)	56	0,02
	08.2023	ZAR	2.121	$	109	0	(3)	(3)	0,00
	09.2023	COP	730.861		172	0	0	0	0,00
	09.2023	ILS	2.338		658	26	0	26	0,01
	09.2023	INR	385.462		4.685	0	0	0	0,00
	09.2023	THB	51.883		1.513	39	0	39	0,02
	09.2023	$	83	NGN	49.296	0	(21)	(21)	(0,01)
	09.2023		1.963	PEN	7.229	19	0	19	0,01
	09.2023		1.414	THB	48.585	0	(34)	(34)	(0,01)
	10.2023	MXN	129.137	$	7.355	0	(30)	(30)	(0,01)
	10.2023	$	128	NGN	79.447	0	(30)	(30)	(0,01)
	11.2023	HUF	205.375	€	443	0	(98)	(98)	(0,04)
	12.2023	NGN	67.068	$	108	26	0	26	0,01
	12.2023	$	130	NGN	81.907	0	(30)	(30)	(0,01)
	01.2024		50	EGP	1.641	0	(5)	(5)	0,00
	02.2024	EGP	47.299	$	1.248	0	(20)	(20)	(0,01)
	04.2024	KES	133.703		870	0	(13)	(13)	(0,01)
MBC	07.2023	$	1	KES	146	0	0	0	0,00
	07.2023		21	PLN	89	1	0	1	0,00
	08.2023	€	8.529	$	9.412	87	0	87	0,04
	08.2023	HUF	2.616.833		7.669	109	0	109	0,05
	08.2023	¥	1.470.000		10.760	517	0	517	0,22
	08.2023	$	134	€	122	0	0	0	0,00
	08.2023		952	ZAR	18.547	26	0	26	0,01
	09.2023	KRW	7.923	$	6	0	0	0	0,00
	09.2023	$	1.103	INR	91.298	7	0	7	0,00
	09.2023		52	THB	1.772	0	(1)	(1)	0,00
	01.2024		64	EGP	2.100	0	(6)	(6)	0,00
MYI	07.2023	CZK	53.519	$	2.428	2	(30)	(28)	(0,01)
	07.2023	€	2		2	0	0	0	0,00
	07.2023	PLN	431		100	0	(6)	(6)	0,00
	07.2023	$	199	COP	840.548	1	0	1	0,00
	07.2023		385	DKK	2.625	0	0	0	0,00
	07.2023		14	€	13	0	0	0	0,00
	07.2023		29	MYR	132	0	0	0	0,00
	07.2023		141	PLN	596	5	0	5	0,00
	08.2023	DKK	2.621	$	385	0	0	0	0,00
	08.2023	€	1.355		1.469	0	(12)	(12)	(0,01)
	08.2023	TWD	12.030		397	10	0	10	0,00
	08.2023	$	1.464	€	1.352	14	0	14	0,01
	08.2023		4.042	¥	537.176	0	(303)	(303)	(0,13)
	08.2023		5	TWD	157	0	0	0	0,00
	08.2023		179	ZAR	3.493	5	0	5	0,00
	09.2023	THB	23.649	$	691	19	0	19	0,01
	09.2023	$	4.432	IDR	65.926.864	0	(53)	(53)	(0,02)
	09.2023		6.498	THB	222.630	0	(171)	(171)	(0,07)
	10.2023	ZAR	408	$	22	1	0	1	0,00
	01.2024	EGP	18.824		507	0	(7)	(7)	0,00
	01.2024	NGN	116.850		190	50	0	50	0,02
	01.2024	$	306	EGP	10.285	0	(26)	(26)	(0,01)
	02.2024	EGP	38.449	$	923	0	(109)	(109)	(0,05)
RBC	07.2023	$	4.622	MXN	88.927	555	0	555	0,24
	08.2023	£	466	$	589	0	(4)	(4)	0,00
	08.2023	$	15.174	MXN	262.971	35	0	35	0,02
	09.2023		2.206	PEN	8.088	12	0	12	0,01
SCX	07.2023	NGN	50.237	$	95	30	0	30	0,01
	07.2023	$	3.045	MYR	13.996	0	(41)	(41)	(0,02)
	07.2023		12	NGN	9.216	0	0	0	0,00
	08.2023	CNH	1.870	$	272	14	0	14	0,01
	08.2023	$	3.513	CNY	23.983	0	(195)	(195)	(0,08)
	09.2023	PEN	23.124	$	6.277	0	(64)	(64)	(0,03)
	09.2023	THB	53.690		1.555	29	0	29	0,01
	09.2023	TWD	18.663		612	12	0	12	0,01
	09.2023	$	3.084	INR	255.716	24	0	24	0,01
	12.2023		449	KES	66.039	1	0	1	0,00
	01.2024		0	EGP	13	0	0	0	0,00
	01.2024		142	NGN	116.724	0	(2)	(2)	0,00

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung		Zu erhaltende Währung		Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
	06.2024	KES	68.980	$	449	$ 0	$ (1)	$ (1)	0,00
SOG	07.2023	PLN	53.350		12.384	0	(737)	(737)	(0,32)
	07.2023	RON	9.512		2.110	19	0	19	0,01
	09.2023	$	1.103	COP	4.692.294	0	(2)	(2)	0,00
	01.2024		147	EGP	4.785	0	(16)	(16)	(0,01)
SSB	07.2023		16.603	CLP	13.337.338	5	0	5	0,00
	08.2023	CLP	13.375.858	$	16.603	1	0	1	0,00
	09.2023	$	6.819	BRL	34.571	268	0	268	0,12
TOR	08.2023		1.866	¥	247.402	0	(143)	(143)	(0,06)
UAG	07.2023	¥	505.000	$	3.852	357	0	357	0,15
	07.2023	PLN	397		97	0	0	0	0,00
	08.2023	CNY	1.122		163	8	0	8	0,00
	08.2023	£	2.113		2.670	0	(16)	(16)	(0,01)
	09.2023	ILS	2.023		565	18	0	18	0,01
	09.2023	SGD	5.607		4.195	40	0	40	0,02
	10.2023	$	981	ZAR	18.020	0	(36)	(36)	(0,02)
						$ 7.742	$ (6.212)	$ 1.530	0,66

ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklassen Institutional EUR (Partially Hedged) thesaurierend und Class E EUR (Partially Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung		Zu erhaltende Währung		Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2023	€	3.038	$	3.286	$ 0	$ (28)	$ (28)	(0,01)
	07.2023	THB	17.888		503	0	(2)	(2)	0,00
	07.2023	$	0	BRL	1	0	0	0	0,00
	07.2023		6.085	€	5.662	92	0	92	0,04
	08.2023		504	THB	17.888	2	0	2	0,00
BPS	07.2023	BRL	0	$	0	0	0	0	0,00
	07.2023	CNY	17.239		2.386	11	0	11	0,01
	07.2023	€	24.212		26.529	114	0	114	0,05
	07.2023	$	25.374	€	23.603	378	0	378	0,16
	08.2023		2.386	CNY	17.215	0	(6)	(6)	0,00
	08.2023		26.555	€	24.202	0	(116)	(116)	(0,05)
BRC	07.2023		2.850	PLN	12.033	112	0	112	0,05
BSH	07.2023		6		24	0	0	0	0,00
CBK	07.2023	€	2	$	3	0	0	0	0,00
	07.2023	INR	52		1	0	0	0	0,00
	07.2023	MXN	20.510		1.193	0	(2)	(2)	0,00
	07.2023	$	100	BRL	477	0	(1)	(1)	0,00
	07.2023		391	€	362	3	0	3	0,00
	07.2023		1.140	MXN	20.510	56	0	56	0,02
	07.2023		295	TRY	7.190	0	(20)	(20)	(0,01)
	08.2023	BRL	477	$	99	1	0	1	0,00
	08.2023	$	1.187	MXN	20.510	3	0	3	0,00
GLM	07.2023	BRL	479	$	96	0	(4)	(4)	0,00
	07.2023	$	346	RON	1.604	7	0	7	0,00
	07.2023		518	THB	17.888	0	(13)	(13)	(0,01)
JPM	07.2023	€	22.383	$	24.440	20	0	20	0,01
	07.2023	INR	137.691		1.663	0	(16)	(16)	(0,01)
	07.2023	$	1.679	INR	137.810	1	0	1	0,00
	08.2023	INR	137.936	$	1.679	0	(1)	(1)	0,00
	08.2023	$	24.475	€	22.383	0	(21)	(21)	(0,01)
MBC	07.2023	€	3.950	$	4.263	0	(47)	(47)	(0,02)
	07.2023	$	17	CNY	120	0	0	0	0,00
	07.2023		397	€	367	4	0	4	0,00
	07.2023		233	£	188	6	0	6	0,00
MYI	07.2023	PLN	12.063	$	2.978	9	0	9	0,00
	07.2023	TRY	1		0	0	0	0	0,00
	07.2023	$	343	IDR	5.171.080	2	0	2	0,00
	08.2023	IDR	5.173.035	$	343	0	(1)	(1)	0,00
	08.2023	$	2.978	PLN	12.080	0	(9)	(9)	0,00
SCX	07.2023		0	IDR	7.297	0	0	0	0,00
SOG	07.2023		25.381	€	23.594	360	0	360	0,16
TOR	07.2023	£	188	$	239	0	0	0	0,00
	08.2023	$	239	£	188	0	0	0	0,00
UAG	07.2023	IDR	5.151.443	$	343	0	0	0	0,00
	07.2023	$	2.442	CNY	17.166	0	(77)	(77)	(0,03)
						$ 1.181	$ (364)	$ 817	0,35

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklasse Institutional GBP (Partially Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung		Zu erhaltende Währung		Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2023	£	33	$	42	$ 0	$ 0	$ 0	0,00
	07.2023	PLN	158		39	0	0	0	0,00
	07.2023	THB	223		6	0	0	0	0,00
	07.2023	$	2	TRY	41	0	0	0	0,00
	08.2023		39	PLN	158	0	0	0	0,00
	08.2023		6	THB	223	0	0	0	0,00
BRC	07.2023		37	PLN	158	1	0	1	0,00
BSH	07.2023		0		0	0	0	0	0,00
CBK	07.2023	£	44	$	55	0	(1)	(1)	0,00
	07.2023	INR	1		0	0	0	0	0,00
	07.2023	MXN	255		15	0	0	0	0,00
	07.2023	$	12	MXN	213	1	0	1	0,00
	08.2023		15		255	0	0	0	0,00
GLM	07.2023		6	THB	223	0	0	0	0,00
JPM	07.2023	€	34	$	37	0	0	0	0,00
	07.2023	£	212		269	0	(1)	(1)	0,00
	07.2023	INR	1.731		21	0	0	0	0,00
	07.2023	$	21	INR	1.732	0	0	0	0,00
	08.2023	INR	1.734	$	21	0	0	0	0,00
	08.2023	$	37	€	34	0	0	0	0,00
	08.2023		269	£	212	1	0	1	0,00
MBC	07.2023		0	CNY	2	0	0	0	0,00
	07.2023		290	£	234	8	0	8	0,01
MYI	07.2023		323		260	7	0	7	0,00
	07.2023		3	IDR	50.512	0	0	0	0,00
	07.2023		3	ZAR	64	0	0	0	0,00
	08.2023	IDR	50.531	$	3	0	0	0	0,00
	09.2023	$	2	TRY	42	0	0	0	0,00
SCX	07.2023		0	IDR	71	0	0	0	0,00
	07.2023		2	MXN	42	0	0	0	0,00
SOG	07.2023		37	€	34	1	0	1	0,00
	07.2023	ZAR	64	$	3	0	0	0	0,00
	08.2023	$	3	ZAR	64	0	0	0	0,00
TOR	07.2023	£	262	$	333	0	0	0	0,00
	08.2023	$	333	£	262	0	0	0	0,00
UAG	07.2023	IDR	50.320	$	3	0	0	0	0,00
	07.2023	$	31	CNY	219	0	(1)	(1)	0,00
	07.2023		71	£	57	1	0	1	0,00
	07.2023		3	TRY	77	0	0	0	0,00
						$ 20	$ (3)	$ 17	0,01
Summe Freiverkehrsfinanzderivate								**$ 3.678**	**1,60**

BESCHREIBUNG		PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
EINLAGENZERTIFIKATE				
Banco Davivienda S.A.				
13,501 % fällig am 13.12.2024	COP	1.000.000	$ 240	0,10
15,389 % fällig am 21.02.2024		289.500	70	0,03
BanColombia S.A.				
5,917 % fällig am 27.01.2024		1.311.000	302	0,13
13,320 % fällig am 08.06.2025		540.000	130	0,06
13,637 % fällig am 14.12.2024		1.432.000	345	0,15
16,137 % fällig am 01.09.2024		561.000	136	0,06
BBVA Colombia S.A.				
5,870 % fällig am 15.07.2024		1.187.000	267	0,11
14,540 % fällig am 13.01.2024		543.100	129	0,06
Summe Einlagenzertifikate			**$ 1.619**	**0,70**
Summe Anlagen			**$ 228.545**	**99,12**
Sonstige Aktiva und Passiva			**$ 2.023**	**0,88**
Nettovermögen			**$ 230.568**	**100,00**

ERLÄUTERUNGEN ZUR AUFSTELLUNG DES WERTPAPIERBESTANDS (Angaben in Tausend*):

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

^ **Das Wertpapier ist in Verzug.**

(a) **Wertpapier per Emissionstermin.**

(b) **Wertpapier mit Sachwertausschüttung.**

(c) **Nullkuponwertpapier.**

(d) **Der Kupon stellt eine Rendite bis zur Endfälligkeit dar.**

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

(f) Mit dem Fonds verbunden.

(g) Bedingt wandelbares Wertpapier.

Barmittel in Höhe von 7.501 USD (31. Dezember 2022: 4.974 USD) wurden zum 30. Juni 2023 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Barmittel in Höhe von 2.161 USD (31. Dezember 2022: 5.521 USD) wurden zum 30. Juni 2023 gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. als Sicherheit für Finanzderivate verpfändet.

Beizulegender Zeitwert[1]

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 30. Juni 2023 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie[2]	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	$ 0	$ 201.556	$ 4.083	$ 205.639
Investmentfonds	12.618	0	0	12.618
Pensionsgeschäfte	0	939	0	939
Finanzderivate[3]	(29)	7.759	0	7.730
Einlagen bei Kreditinstituten	0	501	1.118	1.619
Summen	**$ 12.589**	**$ 210.755**	**$ 5.201**	**$ 228.545**

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

Kategorie[2]	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	$ 0	$ 180.287	$ 1.313	$ 181.600
Investmentfonds	14.173	624	0	14.797
Pensionsgeschäfte	0	706	0	706
Finanzderivate[3]	126	3.194	(7)	3.313
Einlagen bei Kreditinstituten	0	0	137	137
Summen	**$ 14.299**	**$ 184.811**	**$ 1.443**	**$ 200.553**

(1) Weitere Informationen finden Sie in den Erläuterungen in Erläuterung 3.

(2) Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung des Wertpapierbestands.

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

Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC-Finanzderivate und -Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2023 und 31. Dezember 2022:

	Zum 30. Jun. 2023			Zum 31. Dez. 2022		
Kontrahent	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-engagement[1]	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-engagement[1]
AZD	$ k. A.	$ k. A.	$ k. A.	$ (17)	$ 0	$ (17)
BOA	(46)	600	554	(2.672)	2.460	(212)
BPS	520	(460)	60	(2.204)	1.480	(724)
BRC	2.030	(1.920)	110	(334)	510	176
CBK	(156)	0	(156)	(169)	10	(159)
CLY	k. A.	k. A	k. A	(239)	0	(239)
DUB	(146)	0	(146)	653	(650)	3
FAR	81	0	81	k. A.	k. A.	k. A.
GLM	763	(590)	173	(338)	440	102
GST	110	(360)	(250)	203	(260)	(57)
HUS	(12)	0	(12)	(8)	0	(8)
IND	(34)	80	(46)	(94)	340	246
JPM	(245)	210	(35)	224	0	224
MBC	711	(620)	91	847	(804)	43
MYC	61	0	61	84	0	84
MYI	(612)	551	(61)	(104)	281	177
RBC	598	(670)	(72)	(4)	0	(4)
SCX	(153)	260	107	922	(790)	132
SOG	(375)	460	85	86	0	86
SSB	274	(350)	(76)	630	(630)	0
TOR	(143)	0	(143)	151	0	151
UAG	452	(470)	(18)	251	(420)	(169)

(1) Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären.

Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung des Wertpapierbestands zum 30. Juni 2023:

	30. Jun. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	64,86	54,96
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	24,33	32,75
Sonstige übertragbare Wertpapiere	k. A.	0,83
Investmentfonds	5,47	7,21
Pensionsgeschäfte	0,41	0,34
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	(0,53)	0,34
Zentral abgerechnete Finanzderivate	2,28	2,31
Freiverkehrsfinanzderivate	1,60	(1,04)
Einlagenzertifikate	0,70	0,07

Das Anlageportfolio des Fonds konzentriert sich zum 30. Juni 2023 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	30. Jun. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
Argentinien	k. A.	0,49
Bahamas	k. A.	0,37
Weissrussland	k. A.	0,08
Brasilien	2,19	2,65
Cayman-Inseln	0,45	0,70
Chile	3,66	k. A.
China	0,00	0,02
Kolumbien	0,21	k. A.
Kongo	0,23	0,27
Tschechische Republik	1,67	k. A.
Dänemark	0,24	2,08
Dominikanische Republik	3,81	1,52
Ghana	k. A.	0,48
Guatemala	0,39	k. A.
Ungarn	1,21	k. A.
Indien	0,21	k. A.
Irland	2,79	3,14
Israel	2,59	2,82
Elfenbeinküste	0,37	0,45
Jersey, Kanalinseln	k. A.	1,29
Luxemburg	0,04	1,19
Malaysia	1,66	k. A.
Mexiko	2,32	4,32
Niederlande	1,23	2,16
Panama	0,20	k. A.
Paraguay	0,22	k. A.
Peru	4,58	3,18
Polen	5,12	1,16
Rumänien	0,67	k. A.
Russland	0,06	0,05
Serbien	0,05	0,05
Südafrika	7,55	5,04
Südkorea	0,24	k. A.
Supranational	0,21	k. A.
Schweiz	0,19	k. A.
Tunesien	0,09	0,09
Türkei	0,86	0,91
Vereinigte Arabische Emirate	1,00	0,26
Großbritannien	1,34	1,36
USA	21,46	20,18
Usbekistan	0,57	0,62
Jungferninseln (Britisch)	k. A.	1,24
Sambia	0,38	k. A.
Kurzfristige Instrumente	19,13	30,37
Investmentfonds	5,47	7,21
Pensionsgeschäfte	0,41	0,34
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	(0,53)	0,34
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen — Schutzverkauf	0,00	k. A.
Credit Default Swaps auf Kreditindizes— Schutzverkauf	0,26	0,08
Zinsswaps	2,02	2,23
Freiverkehrsfinanzderivate		
Optionskauf		
Devisenoptionen	0,62	0,29
Straddle-Optionen	0,00	k. A.
Verkaufsoptionen		
Devisenoptionen	(0,13)	k. A.
Zinsswapoptionen	k. A.	(0,01)
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen — Schutzkauf	0,04	0,00
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen — Schutzverkauf	(0,02)	(0,42)
Cross-Currency Swaps	0,03	0,04
Zinsswaps	0,04	0,12
Volatilitätsswaps	k. A.	0,00
Devisenterminkontrakte	0,66	(1,81)
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	0,36	0,75
Einlagenzertifikate	0,70	0,07
Sonstige Aktiva und Passiva	0,88	2,23
Nettovermögen	100,00	100,00

Aufstellung des Wertpapierbestands des Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund

BESCHREIBUNG		PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE				
ASERBAIDSCHAN				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
SOCAR Turkey Enerji AS Via Steas Funding DAC				
7,230 % fällig am 17.03.2026	$	200	$ 195	0,97
BRASILIEN				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Odebrecht Oil & Gas Finance Ltd.				
0,000 % fällig am 31.07.2023 (b)(e)		23	0	0,00
Oi S.A.				
0,000 % fällig am 25.02.2035	BRL	50	9	0,05
Swiss Insured Brazil Power Finance SARL				
9,850 % fällig am 16.07.2032		2.502	478	2,38
Vale S.A.				
0,000 % (e)		1.490	95	0,47
Summe Brasilien			582	2,90
CAYMAN INSELN				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Interoceanica Finance Ltd.				
0,000 % fällig am 30.11.2025 (b)	$	14	13	0,07
CHILE				
STAATSEMISSIONEN				
Bonos de la Tesoreria de la Republica en Pesos				
5,000 % fällig am 01.10.2028	CLP	30.000	37	0,18
6,000 % fällig am 01.04.2033		55.000	72	0,36
6,000 % fällig am 01.01.2043		5.000	7	0,04
Summe Chile			116	0,58
CHINA				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Flourish Century				
6,600 % fällig am 04.02.2022 ^(h)	$	200	22	0,11
STAATSEMISSIONEN				
China Government International Bond				
3,020 % fällig am 27.05.2031	CNY	600	85	0,42
Summe China			107	0,53
KOLUMBIEN				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Empresas Publicas de Medellin ESP				
7,625 % fällig am 10.09.2024	COP	540.000	120	0,60
STAATSEMISSIONEN				
Financiera de Desarrollo Territorial S.A. Findeter				
7,875 % fällig am 12.08.2024		12.000	3	0,01
Summe Kolumbien			123	0,61
TSCHECHISCHE REPUBLIK				
STAATSEMISSIONEN				
Czech Republic Government International Bond				
2,000 % fällig am 13.10.2033	CZK	400	15	0,07
2,500 % fällig am 25.08.2028		4.600	192	0,96
Summe Tschechische Republik			207	1,03
DÄNEMARK				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Jyske Realkredit A/S				
1,500 % fällig am 01.10.2053	DKK	0	0	0,00
Nordea Kredit Realkreditaktieselskab				
1,000 % fällig am 01.10.2050		0	0	0,00
1,500 % fällig am 01.10.2053		0	0	0,00
Nykredit Realkredit A/S				
1,000 % fällig am 01.10.2050		0	0	0,00
1,000 % fällig am 01.10.2053		0	0	0,00
1,500 % fällig am 01.10.2053		0	0	0,00
Realkredit Danmark A/S				
1,000 % fällig am 01.10.2050		0	0	0,00
1,500 % fällig am 01.10.2053		0	0	0,00
Summe Dänemark			0	0,00
DOMINIKANISCHE REPUBLIK				
STAATSEMISSIONEN				
Zentralbanknoten der Dominikanischen Republik				
12,000 % fällig am 03.10.2025	DOP	3.800	$ 72	0,36
13,000 % fällig am 30.01.2026		3.200	63	0,31
Dominican Republic Government International Bond				
13,625 % fällig am 03.02.2033		8.000	180	0,90
13,625 % fällig am 10.02.2034		200	4	0,02
Summe Dominikanische Republik			319	1,59
UNGARN				
STAATSEMISSIONEN				
Ungarische Entwicklungsbank				
0,375 % fällig am 09.06.2026	€	100	95	0,47
6,500 % fällig am 29.06.2028	$	200	198	0,99
Hungary Government International Bond				
4,750 % fällig am 24.11.2032	HUF	6.200	15	0,08
5,000 % fällig am 22.02.2027	€	50	55	0,27
6,750 % fällig am 22.10.2028	HUF	4.200	12	0,06
Summe Ungarn			375	1,87
INDONESIEN				
STAATSEMISSIONEN				
Indonesia Government International Bond				
7,500 % fällig am 15.06.2035	IDR	65.000	5	0,02
IRLAND				
FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE				
Black Diamond CLO DAC				
4,060 % fällig am 20.01.2032	€	84	90	0,45
Carlyle Global Market Strategies Euro CLO Ltd.				
4,073 % fällig am 15.11.2031		100	107	0,53
Harvest CLO DAC				
4,250 % fällig am 26.06.2030		89	95	0,47
			292	1,45
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Alfa Bank AO Via Alfa Bond Issuance PLC				
9,350 % fällig am 06.08.2022 ^	RUB	33.000	11	0,06
Summe Irland			303	1,51
ISRAEL				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Bank Leumi Le-Israel B.M.				
7,129 % fällig am 18.07.2033 (g)	$	200	198	0,98
STAATSEMISSIONEN				
Israel Government International Bond				
0,150 % fällig am 31.07.2023	ILS	400	108	0,54
1,500 % fällig am 30.11.2023		500	133	0,66
			241	1,20
Summe Israel			439	2,18
JERSEY, KANALINSELN				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Corsair International Ltd.				
7,772 % fällig am 28.01.2027	€	100	109	0,54
		AKTIEN		
LUXEMBURG				
STAMMAKTIEN				
DrillCo Holding Lux S.A. (a)		311	6	0,03
DrillCo Holding Lux S.A. (a)(h)		787	15	0,08
Summe Stammaktien			21	0,11
		PAR (000S)		
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
FORESEA Holding S.A.				
7,500 % fällig am 15.06.2030	$	14	12	0,06
Sberbank of Russia Via SB Capital S.A.				
5,250 % fällig am 23.05.2023 ^(g)		200	12	0,06
			24	0,12
Summe Luxemburg			45	0,23
MALAYSIA				
STAATSEMISSIONEN				
Malaysia Government International Bond				
2,632 % fällig am 15.04.2031	MYR	30	$ 6	0,03
3,800 % fällig am 17.08.2023		5.400	1.158	5,77
Malaysia Government Investment Issue				
3,422 % fällig am 30.09.2027		30	6	0,03
3,990 % fällig am 15.10.2025		400	87	0,43
4,369 % fällig am 31.10.2028		110	24	0,12
Summe Malaysia			1.281	6,38
MEXIKO				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Petroleos Mexicanos				
10,000 % fällig am 07.02.2033	$	50	46	0,23
Urbi Desarrollos Urbanos S.A.B. de C.V.				
8,790 % fällig am 09.12.2014 ^	MXN	5.000	0	0,00
			46	0,23
STAATSEMISSIONEN				
Mexico Government International Bond				
5,000 % fällig am 06.03.2025		1.800	97	0,48
7,000 % fällig am 03.09.2026		4.900	267	1,33
7,500 % fällig am 03.06.2027		4.700	260	1,30
7,750 % fällig am 29.05.2031		2.300	127	0,63
8,500 % fällig am 31.05.2029		500	29	0,14
			780	3,88
Summe Mexiko			826	4,11
NIEDERLANDE				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Angola Via Avenir BV				
10,163 % fällig am 07.12.2023	$	5	5	0,03
PERU				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Banco de Credito del Peru S.A.				
4,650 % fällig am 17.09.2024	PEN	1.230	326	1,62
STAATSEMISSIONEN				
Fondo MIVIVIENDA S.A.				
7,000 % fällig am 14.02.2024		130	35	0,17
Peru Government International Bond				
7,300 % fällig am 12.08.2033		400	114	0,57
			149	0,74
Summe Peru			475	2,36
POLEN				
STAATSEMISSIONEN				
Poland Government International Bond				
1,250 % fällig am 25.10.2030	PLN	150	27	0,14
2,750 % fällig am 25.10.2029		300	63	0,31
6,000 % fällig am 25.10.2033		200	50	0,25
7,500 % fällig am 25.07.2028		300	80	0,40
Summe Polen			220	1,10
RUMÄNIEN				
STAATSEMISSIONEN				
Romania Government International Bond				
4,250 % fällig am 28.04.2036	RON	100	17	0,09
SÜDAFRIKA				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Entwicklungsbank für das südliche Afrika				
8,600 % fällig am 21.10.2024 (h)	ZAR	3.200	167	0,83
Eskom Holdings SOC Ltd.				
7,850 % fällig am 02.04.2026		5.000	252	1,25
			419	2,08
STAATSEMISSIONEN				
South Africa Government International Bond				
2,000 % fällig am 31.01.2025 (d)		2.615	134	0,67
7,000 % fällig am 28.02.2031		800	34	0,17

BESCHREIBUNG		PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
10,500 % fällig am 21.12.2026	ZAR	2.000	$ 110	0,55
			278	1,39
Summe Südafrika			697	3,47
GROSSBRITANNIEN				
NON-AGENCY-MBS				
Harbour				
5,457 % fällig am 28.01.2054	£	100	125	0,62
USA				
FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE				
Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust				
5,161 % fällig am 25.01.2035	$	34	33	0,16
Citigroup Mortgage Loan Trust				
5,210 % fällig am 25.07.2045		7	5	0,03
Countrywide Asset-Backed Certificates Trust				
5,630 % fällig am 25.02.2037		47	45	0,22
6,275 % fällig am 25.11.2035		60	58	0,29
Credit-Based Asset Servicing & Securitization Trust				
5,270 % fällig am 25.11.2036		2	1	0,01
Fieldstone Mortgage Investment Trust				
5,530 % fällig am 25.05.2036		75	51	0,25
GSAMP Trust				
5,240 % fällig am 25.01.2037		46	27	0,13
Home Equity Asset Trust				
5,750 % fällig am 25.11.2032		4	3	0,01
HSI Asset Loan Obligation Trust				
4,194 % fällig am 25.12.2036		2	1	0,01
Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust				
5,210 % fällig am 25.05.2037		3	2	0,01
5,915 % fällig am 25.01.2035		23	22	0,11
5,945 % fällig am 25.03.2034		46	44	0,22
Morgan Stanley Dean Witter Capital, Inc. Trust				
6,500 % fällig am 25.02.2033		15	15	0,07
New Century Home Equity Loan Trust				
5,510 % fällig am 25.05.2036		7	7	0,04
Saxon Asset Securities Trust				
5,460 % fällig am 25.09.2037		11	10	0,05
Soundview Home Loan Trust				
5,230 % fällig am 25.06.2037		4	3	0,01
5,320 % fällig am 25.07.2037		59	48	0,24
Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust				
5,370 % fällig am 25.10.2037		136	87	0,43
WaMu Asset-Backed Certificates WaMu Trust				
5,390 % fällig am 25.05.2037		50	42	0,21
Washington Mutual Asset-Backed Certificates Trust				
3,911 % fällig am 25.10.2036		4	1	0,0
			505	2,5
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Rio Oil Finance Trust				
9,250 % fällig am 06.07.2024	$	139	$ 141	0,7
NON-AGENCY-MBS				
Banc of America Mortgage Trust				
5,268 % fällig am 25.07.2034		0	0	0,0
Bear Stearns Adjustable Rate Mortgage Trust				
3,887 % fällig am 25.05.2047 ^		6	5	0,0
Bear Stearns ALT-A Trust				
3,744 % fällig am 25.04.2037		184	138	0,6
Bear Stearns Structured Products, Inc. Trust				
3,484 % fällig am 26.12.2046 ^		13	9	0,0
Citigroup Mortgage Loan Trust				
3,974 % fällig am 25.09.2037 ^		82	72	0,3
5,220 % fällig am 25.01.2037		2	2	0,0
First Horizon Mortgage Pass-Through Trust				
4,715 % fällig am 25.08.2035		3	2	0,0
GreenPoint Mortgage Funding Trust Pass-Through Certificates				
4,725 % fällig am 25.10.2033		1	1	0,0
IndyMac Mortgage Loan Trust				
3,062 % fällig am 25.11.2037		68	56	0,2
3,916 % fällig am 25.12.2034		3	2	0,0
5,790 % fällig am 25.07.2045		28	22	0,1
Lehman XS Trust				
5,530 % fällig am 25.09.2046		105	90	0,4
Residential Accredit Loans, Inc. Trust				
4,398 % fällig am 25.10.2037		44	39	0,1
Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust				
6,000 % fällig am 25.10.2036		2	2	0,0
WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust				
3,772 % fällig am 25.02.2037 ^		7	6	0,0
			446	2,2
Summe USA			1.092	5,4
URUGUAY				
STAATSEMISSIONEN				
Uruguay Government International Bond				
3,700 % fällig am 26.06.2037 (d)	UY U	691	19	0,0
3,875 % fällig am 02.07.2040 (d)		1.624	46	0,2
Summe Uruguay			65	0,3
SAMBIA				
STAATSEMISSIONEN				
Zambia Government International Bond				
13,000 % fällig am 25.01.2031	ZM W	500	17	0,0
KURZFRISTIGE INSTRUMENTE				
KURZFRISTIGE SCHULDTITEL				
Korea Monetary Stabilization Bond				
3,569 % fällig am 19.09.2023 (b)(c)	KRW	2.568.870	$ 1.935	9,6
HUNGARY TREASURY BILLS				
16,220 % fällig am 06.07.2023 (b)(c)	HUF	251.000	733	3,6
ISRAEL TREASURY BILLS				
4,701 % fällig am 03.01.2024 (b)(c)	ILS	6.400	1.684	8,3
U.S. TREASURY BILLS				
5,290 % fällig am 24.08.2023 (b)(c)	$	1.600	1.588	7,9
5,405 % fällig am 26.09.2023 (b)(c)		3.700	3.655	18,1
			5.243	26,1
Summe kurzfristige Instrumente			9.595	47,7
Summe Übertragbare Wertpapiere			**$ 17.353**	**86,4**
		AKTIEN		
INVESTMENTFONDS				
ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN				
PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (f)		507	5	0,0
PIMCO Specialty Funds Ireland p.l.c. - PIMCO China Bond Fund (f)		15.103	197	0,9
			202	1,0
BÖRSENGEHANDELTE FONDS				
PIMCO ETFs plc - PIMCO US Dollar Short Maturity UCITS ETF (f)		17.700	1.758	8,7
Summe Investmentfonds			**$ 1.960**	**9,7**

PENSIONSGESCHÄFTE

Kontrahent	Kredit-zins	Abrechnungs-datum	Fälligkeits-datum	Kapital-betrag	Besihert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensions-geschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensions-geschäft[1]	% des Nettovermögens
SSB	2,400 %	30.06.2023	03.07.2023	$ 150	U.S. Treasury Notes 1,875 % fällig am 30.06.2026	$ (153)	$ 150	$ 150	0,75
Summe Pensionsgeschäfte						**$ (153)**	**$ 150**	**$ 150**	**0,75**

(1) Umfasst aufgelaufene Zinsen.

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

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

FUTURES

Beschreibung	Art	Ablauf-monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Euro-Bobl September Futures	Short	09.2023	1	$ 2	0,01
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate				**$ 2**	**0,01**

ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)

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

ZINSSWAPS

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits-datum		Nenn-betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Erhalt	1-Day INR-MIBOR Compounded-OIS	6,750 %	15.03.2028	INR	5.600	$ 1	0,00
Zahlung	1-Day SGD-SIBCSORA Compounded-OIS	2,750	15.03.2028	SGD	40	0	0,00
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,250	21.06.2028	$	1.450	51	0,25
Zahlung	1-Year BRL-CDI	6,140	04.01.2027	BRL	1.400	(34)	(0,16)
Erhalt	1-Year BRL-CDI	8,325	04.01.2027		300	5	0,02
Zahlung	1-Year BRL-CDI	8,450	04.01.2027		300	(5)	(0,02)
Erhalt	1-Year BRL-CDI	8,675	04.01.2027		1.700	(4)	(0,02)
Erhalt	1-Year BRL-CDI	10,240	04.01.2027		400	(1)	(0,01)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	10,565	04.01.2027		1.300	3	0,01
Erhalt	1-Year BRL-CDI	11,244	02.01.2026		800	(3)	(0,02)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,405	02.01.2029		100	0	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,420	02.01.2026		900	4	0,02
Erhalt	1-Year BRL-CDI	11,708	02.01.2025		100	0	0,00
Erhalt	1-Year BRL-CDI	11,740	02.01.2025		200	0	0,00
Erhalt	1-Year BRL-CDI	11,750	02.01.2025		200	0	0,00
Erhalt	1-Year BRL-CDI	12,350	01.07.2024		1.300	(1)	0,00
Erhalt	1-Year BRL-CDI	12,490	01.07.2024		1.400	(1)	(0,01)
Erhalt	1-Year BRL-CDI	12,533	02.01.2029		400	(5)	(0,03)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	12,595	01.07.2024		1.200	1	0,01
Zahlung	1-Year BRL-CDI	12,684	02.01.2029		500	7	0,03
Zahlung	1-Year BRL-CDI	12,746	02.01.2029		500	7	0,04
Zahlung	1-Year BRL-CDI	13,080	01.07.2024		2.600	5	0,03
Erhalt	1-Year BRL-CDI	13,215	02.01.2025		200	(1)	(0,01)
Erhalt	1-Year BRL-CDI	13,218	02.01.2029		1.000	(17)	(0,08)
Erhalt	3-Month CNY-CNREPOFIX	1,860	07.05.2025	CNY	1.700	(1)	(0,01)
Erhalt	3-Month CNY-CNREPOFIX	2,500	21.09.2027		2.770	(1)	(0,01)
Zahlung	3-Month CNY-CNREPOFIX	2,500	15.03.2028		790	0	0,00
Erhalt	3-Month CNY-CNREPOFIX	2,750	15.03.2028		420	(1)	(0,01)
Zahlung[1]	3-Month CNY-CNREPOFIX	2,750	20.09.2028		500	0	0,00
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	2,995	24.11.2025	COP	113.800	4	0,02
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	3,125	15.01.2026		386.000	13	0,06
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	3,975	23.06.2027		216.900	7	0,03
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	4,040	13.01.2031		1.002.000	50	0,24
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	4,200	18.09.2030		824.860	(14)	(0,07)
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	5,175	28.05.2027		1.045.600	21	0,11
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	6,630	11.01.2027		1.088.400	14	0,07
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	7,080	02.02.2027		79.000	1	0,00
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	7,130	31.01.2027		81.000	1	0,00
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	7,140	01.02.2027		149.300	1	0,01
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	7,500	15.02.2025		112.850	1	0,01
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	7,585	14.02.2027		236.000	(1)	0,00
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	7,890	08.04.2027		173.000	0	0,00
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	7,913	08.04.2027		266.200	1	0,00
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	7,940	08.04.2027		134.000	0	0,00
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	8,190	13.06.2029		494.700	4	0,02
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	8,200	11.03.2027		366.000	1	0,00
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	8,240	15.03.2027		101.600	0	0,00
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	8,305	28.04.2028		341.800	2	0,01
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	8,320	31.03.2027		203.000	1	0,00
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	8,390	13.06.2028		179.900	1	0,01
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	8,560	30.03.2027		58.200	0	0,00
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	8,686	30.03.2027		346.500	2	0,01
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	8,820	05.06.2028		314.400	(4)	(0,02)
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	8,890	12.05.2029		269.000	4	0,02
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	8,940	24.03.2030		431.000	(8)	(0,04)
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	9,050	03.11.2027		3.357.000	34	0,17
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	9,050	02.05.2033		35.360	1	0,00
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	9,055	26.08.2026		200.000	(1)	0,00
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	9,177	26.11.2025		218.700	0	0,00
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	9,270	26.11.2025		243.000	(1)	0,00
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	9,280	26.11.2025		610.000	(1)	(0,01)
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	9,310	26.11.2025		473.000	(1)	(0,01)
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	9,370	17.03.2030		73.900	(2)	(0,01)
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	9,393	21.03.2030		172.000	(4)	(0,02)
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	9,423	17.03.2030		218.700	(5)	(0,03)
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	9,430	16.06.2027		130.000	(2)	(0,01)
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	9,470	01.07.2025		285.000	0	0,00
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	10,110	26.11.2025		274.280	(2)	(0,01)
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	11,640	21.10.2025		817.000	(11)	(0,05)
Erhalt	3-Month ILS-TELBOR	3,590	18.05.2028	ILS	200	0	0,00
Zahlung	3-Month KRW-KORIBOR	2,665	15.03.2028	KRW	119.500	(1)	0,00
Zahlung	3-Month KRW-KORIBOR	3,250	15.03.2033		326.460	(3)	(0,01)
Erhalt	3-Month THB-THORON Compounded-OIS	2,250	15.03.2028	THB	4.520	1	0,01
Zahlung	3-Month THB-THORON Compounded-OIS	2,750	15.03.2033		50	0	0,00
Erhalt	3-Month ZAR-JIBAR	5,375	20.10.2026	ZAR	2.740	14	0,07
Erhalt	3-Month ZAR-JIBAR	6,067	21.12.2026		3.100	10	0,05

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits-datum		Nenn-betrag		Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Erhalt	3-Month ZAR-JIBAR	6,635 %	04.02.2027	ZAR	5.500	$	2	0,01
Erhalt	3-Month ZAR-JIBAR	7,205	22.04.2027		1.200		3	0,01
Erhalt	3-Month ZAR-JIBAR	7,210	22.04.2027		900		2	0,01
Erhalt	3-Month ZAR-JIBAR	7,565	22.03.2026		2.900		3	0,02
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	8,500	17.10.2027		8.760		(2)	(0,01)
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	8,830	23.02.2030		800		0	0,00
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	9,290	26.05.2028		2.500		2	0,01
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	2,080	01.06.2030	CLP	62.000		(13)	(0,07)
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	2,110	01.06.2030		20.000		(4)	(0,02)
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	3,120	05.02.2030		29.000		(4)	(0,02)
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	3,215	14.01.2030		143.000		26	0,13
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	5,030	20.03.2033		189.200		4	0,02
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	5,180	01.10.2028		35.000		0	0,00
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	5,240	01.09.2030		37.210		0	0,00
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	5,370	01.10.2028		17.900		0	0,00
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	5,400	20.03.2028		155.400		(2)	(0,01)
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	5,400	01.10.2028		35.000		0	0,00
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	5,420	01.10.2028		76.000		0	0,00
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	5,470	01.09.2030		50.000		(1)	0,00
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	5,570	01.10.2028		70.000		0	0,00
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	5,890	17.03.2032		12.100		(2)	(0,01)
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	5,930	17.03.2032		12.100		(2)	(0,01)
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	6,010	16.02.2029		30.000		2	0,01
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	6,020	02.03.2029		2.900		0	0,00
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	6,110	01.09.2030		23.100		2	0,01
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	6,250	01.10.2028		4.600		0	0,00
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	6,370	29.06.2029		39.000		3	0,02
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	6,380	03.06.2027		116.000		5	0,02
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	6,420	24.03.2029		16.000		2	0,01
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	6,550	15.06.2032		16.000		3	0,02
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	6,610	17.06.2032		40.300		6	0,03
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	7,160	01.10.2028		11.600		2	0,01
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	7,195	01.10.2028		6.500		1	0,00
Zahlung	6-Month CZK-PRIBOR	4,611	06.06.2028	CZK	4.700		(1)	(0,01)
Erhalt[1]	6-Month EUR-EURIBOR	2,500	20.09.2053	€	10		0	0,00
Zahlung[1]	6-Month EUR-EURIBOR	3,000	20.09.2028		300		(4)	(0,02)
Erhalt	6-Month HUF-BBR	7,840	07.02.2033	HUF	6.600		0	0,00
Erhalt	6-Month HUF-BBR	8,740	28.04.2028		14.400		(1)	0,00
Erhalt	6-Month HUF-BBR	13,600	12.12.2024		5.100		(1)	(0,01)
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR	0,980	09.06.2030	PLN	300		17	0,09
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR	2,950	13.12.2026		1.500		21	0,10
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR	4,075	07.03.2027		800		9	0,04
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR	4,320	09.03.2027		150		1	0,01
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR	5,220	20.03.2033		200		0	0,00
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR	5,310	21.03.2033		200		(1)	0,00
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR	5,340	28.03.2027		100		0	0,00
Zahlung	6-Month PLN-WIBOR	5,430	16.03.2028		200		0	0,00
Zahlung	6-Month PLN-WIBOR	5,520	20.03.2026		500		0	0,00
Zahlung	6-Month PLN-WIBOR	5,620	21.03.2026		600		0	0,00
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR	6,830	19.08.2024		3.000		(30)	(0,14)
Zahlung	6-Month PLN-WIBOR	7,310	30.06.2027		500		7	0,04
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	4,340	12.02.2024	MXN	22.060		(62)	(0,30)
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	4,850	19.02.2025		3.700		18	0,09
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	6,463	18.05.2040		800		7	0,04
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	7,100	13.06.2031		3.590		15	0,08
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	7,950	20.02.2032		2.000		(1)	(0,01)
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	8,050	24.02.2032		890		0	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	8,300	16.06.2028		600		0	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	8,414	14.12.2027		90		0	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	8,448	27.04.2028		400		0	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	8,457	27.04.2028		800		0	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	8,465	16.08.2027		400		0	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	8,515	17.12.2027		100		0	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	8,560	18.05.2028		100		0	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	8,585	18.05.2028		100		0	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	8,600	18.05.2028		100		0	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	8,600	04.03.2033		1.300		(3)	(0,01)
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	8,656	18.05.2028		100		0	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	8,720	19.05.2028		200		0	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	8,722	19.05.2028		100		0	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	8,728	22.05.2028		700		0	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	8,755	19.05.2028		100		0	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	8,900	21.05.2027		900		(1)	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	9,060	18.06.2027		1.400		(1)	(0,01)
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	9,090	08.07.2027		1.000		(1)	(0,01)
						$	163	0,81
Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate						**$**	**163**	**0,81**

[1] Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft.

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

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

OPTIONSKAUF

DEVISENOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung		Ausübungskurs	Verfallsdatum	Nennbetrag[1]	Kosten	Marktwert	% des Nettovermögens
BOA	Put - OTC EUR versus CZK	CZK	23,830	01.11.2023	25	$ 3	$ 11	0,06
GLM	Put - OTC EUR versus HUF	HUF	385,000	01.11.2023	9	1	6	0,03
	Put - OTC EUR versus PLN	PLN	4,560	01.11.2023	19	2	15	0,07
JPM	Put - OTC EUR versus HUF	HUF	385,000	01.11.2023	19	2	12	0,06
MYI	Put - OTC USD versus BRL	BRL	4,820	22.08.2023	202	2	3	0,01
	Put - OTC USD versus MXN	MXN	18,500	25.07.2023	221	6	16	0,08
RBC	Put - OTC USD versus CAD	CAD	1,305	13.07.2023	228	1	0	0,00
UAG	Call - OTC EUR versus USD	$	1,140	13.07.2023	207	1	0	0,00
	Call - OTC USD versus ZAR	ZAR	20,500	09.10.2023	363	5	4	0,02
						$ 23	$ 67	0,33

STRADDLE-OPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungskurs[2]	Verfallsdatum	Nennbetrag[1]	Kosten[2]	Marktwert	% des Nettovermögens
BOA	Call & Put - OTC 6-Month vs. 6-Month Forward Volatility Agreement	12,600 %	27.12.2023	100	$ 0	$ 0	0,00
	Call & Put - OTC 6-Month vs. 6-Month Forward Volatility Agreement	15,050	27.12.2023	100	0	0	0,00
CBK	Call & Put - OTC 6-Month vs. 6-Month Forward Volatility Agreement	15,100	20.12.2023	400	0	0	0,00
	Call & Put - OTC 6-Month vs. 6-Month Forward Volatility Agreement	12,600	29.12.2023	100	0	0	0,00
MYI	Call & Put - OTC 6-Month vs. 6-Month Forward Volatility Agreement	12,600	27.12.2023	200	0	0	0,00
					$ 0	$ 0	0,00

VERKAUFSOPTIONEN

DEVISENOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung		Ausübungskurs	Verfallsdatum	Nennbetrag[1]	Aufgeld	Marktwert	% des Nettovermögens
JPM	Call - OTC USD versus INR	IDR	14.950,000	06.06.2024	58	$ (2)	$ (2)	(0,01)
	Put - OTC USD versus INR		14.950,000	06.06.2024	58	(2)	(2)	(0,01)
MYI	Call - OTC USD versus CLP	CLP	850,000	18.07.2023	129	(2)	0	0,00
	Put - OTC USD versus MXN	MXN	17,750	25.07.2023	442	(3)	(14)	(0,07)
	Call - OTC USD versus MXN		21,000	07.03.2024	211	(4)	(2)	(0,01)
						$ (13)	$ (20)	(0,10)

(1) Der Nennbetrag stellt die Anzahl der Kontrakte dar.

(2) Ausübungskurs und endgültige Kosten werden zu einem zukünftigen Zeitpunkt auf der Basis impliziter Volatilitätsparameter festgelegt.

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMMISSIONEN - SCHUTZKAUF[1]

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu bezahlender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag[3]	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Marktwert	% des Nettovermögens
BOA	Turkey Government International Bond	(1,000) %	20.06.2024	$ 100	$ 6	$ (4)	$ 2	0,01
GST	Turkey Government International Bond	(1,000)	20.06.2024	100	4	(2)	2	0,01
					$ 10	$ (6)	$ 4	0,02

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMMISSIONEN - SCHUTZVERKAUF[2]

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag[3]	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Marktwert	% des Nettovermögens
GST	Poland Government International Bond	1,000 %	20.06.2024	$ 100	$ 1	$ 0	$ 1	0,00
JPM	Banco do Brasil S.A.	1,000	20.12.2024	100	(2)	1	(1)	0,00
					$ (1)	$ 1	$ 0	0,00

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

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

(3) Der maximal mögliche Betrag, den der Fonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

CROSS-CURRENCY SWAPS

Kontrahent	Erhalt	Zahlung	Fälligkeits-datum	Nennbetrag erhaltener Währung	Nennbetrag gelieferter Währung	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Markt-wert	% des Nettovermögens
GLM	Variabler Zinssatz entspricht 6-Month USD-LIBOR zzgl. 0,333 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung	Variabler Zinssatz entspricht 6-Month ARS-LIBOR basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung	30.05.2024	$ 170	ARS 7.557	$ (1)	$ 163	$ 162	0,81
	Variabler Zinssatz entspricht 6-Month USD-LIBOR zzgl. 0,282 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung	Variabler Zinssatz entspricht 6-Month ARS-LIBOR basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung	07.06.2027	60	2.693	0	58	58	0,29
						$ (1)	$ 221	$ 220	1,10

ZINSSWAPS

Kontrahent	Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Markt-wert	% des Nettovermögens
BOA	Zahlung	3-Month MYR-KLIBOR	3,500 %	15.03.2028	MYR 200	$ 0	$ 0	$ 0	0,00
GLM	Erhalt	3-Month MYR-KLIBOR	3,545	05.05.2028	457	0	1	1	0,01
	Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	3,265	14.06.2029	CLP 11.100	0	(2)	(2)	(0,01)
JPM	Erhalt	3-Month MYR-KLIBOR	3,750	15.03.2028	MYR 1.477	(1)	0	(1)	(0,01)
						$ (1)	$ (1)	$ (2)	(0,01)

DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung		Zu erhaltende Währung		Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2023	KES	4.674	$	33	$ 0	$ 0	$ 0	0,00
	07.2023	PHP	997		18	0	0	0	0,00
	07.2023	PLN	462		111	0	(3)	(3)	(0,01)
	07.2023	$	47	€	43	0	0	0	0,00
	07.2023		699	MXN	12.862	49	0	49	0,25
	07.2023		5	PLN	19	0	0	0	0,00
	07.2023		22	TRY	478	0	(4)	(4)	(0,02)
	08.2023	CNY	183	$	26	1	0	1	0,00
	08.2023	INR	26.736		325	0	(1)	(1)	0,00
	08.2023	MXN	1.664		90	0	(6)	(6)	(0,03)
	08.2023	NZD	68		43	1	0	1	0,01
	08.2023	$	300	CNY	2.059	0	(15)	(15)	(0,08)
	08.2023		7	EGP	249	0	0	0	0,00
	08.2023		22	TWD	672	0	0	0	0,00
	08.2023	ZAR	2.000	$	107	2	0	2	0,01
	09.2023	NGN	2.318		4	1	0	1	0,01
	09.2023	PEN	651		176	0	(3)	(3)	(0,01)
	09.2023	$	14	HKD	109	0	0	0	0,00
	09.2023		420	KRW	531.998	0	(14)	(14)	(0,07)
	09.2023		101	MYR	463	0	(1)	(1)	(0,01)
	09.2023		402	TWD	12.206	0	(9)	(9)	(0,05)
	10.2023		4	KES	624	0	0	0	0,00
	10.2023	ZAR	965	$	52	1	0	1	0,01
	11.2023	€	156	CZK	3.819	3	0	3	0,02
BPS	07.2023	BRL	451	$	94	1	0	1	0,00
	07.2023	€	30		33	0	0	0	0,00
	07.2023	PHP	20.565		366	0	(6)	(6)	(0,03)
	07.2023	PLN	217		52	0	(1)	(1)	0,00
	07.2023	SGD	142		107	2	0	2	0,01
	07.2023	$	56	BRL	282	2	0	2	0,01
	07.2023		61	COP	277.278	5	0	5	0,02
	07.2023		321	CZK	6.914	0	(4)	(4)	(0,02)
	07.2023		436	€	398	0	(1)	(1)	(0,01)
	07.2023		22	£	17	0	0	0	0,00
	07.2023		26	¥	3.682	0	(1)	(1)	(0,01)
	07.2023		480	MYR	2.202	0	(7)	(7)	(0,03)
	07.2023		26	PHP	1.467	1	0	1	0,00
	07.2023		83	SGD	109	0	(2)	(2)	(0,01)
	08.2023	CNH	28	$	4	0	0	0	0,00
	08.2023	CNY	1.071		156	8	0	8	0,04
	08.2023	€	213		234	1	0	1	0,01
	08.2023	MYR	5.479		1.180	2	0	2	0,01
	08.2023	TWD	976		32	1	0	1	0,00
	08.2023	$	354	CNY	2.421	0	(19)	(19)	(0,09)
	08.2023		43	COP	193.120	3	0	3	0,01
	08.2023		200	TWD	6.109	0	(4)	(4)	(0,02)
	08.2023	ZAR	974	$	53	2	0	2	0,01
	09.2023	CLP	25.348		31	0	0	0	0,00

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung		Zu erhaltende Währung		Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
	09.2023	PHP	5.657	$	101	$ 0	$ (1)	$ (1)	(0,01)
	09.2023	THB	2		0	0	0	0	0,00
	09.2023	$	365	PHP	20.565	6	0	6	0,03
	09.2023		48	THB	1.658	0	(1)	(1)	0,00
	12.2023	NGN	810	$	1	0	0	0	0,00
	12.2023	$	70	MXN	1.242	1	0	1	0,00
	01.2024	ILS	6.236	$	1.753	58	0	58	0,29
	01.2024	ZAR	2.047		116	10	0	10	0,05
BRC	07.2023	CZK	91		4	0	0	0	0,00
	07.2023	MYR	189		41	1	0	1	0,00
	07.2023	PLN	122		29	0	(1)	(1)	0,00
	07.2023	RON	856		187	1	(2)	(1)	(0,01)
	07.2023	RSD	5.977		55	0	0	0	0,00
	07.2023	$	42	PLN	173	0	0	0	0,00
	07.2023		90	SGD	120	0	(2)	(2)	(0,01)
	08.2023	COP	2.752.653	$	646	0	(5)	(5)	(0,02)
	08.2023	ZAR	1.530		80	0	(1)	(1)	0,00
	09.2023	IDR	4.959		0	0	0	0	0,00
	09.2023	MXN	7.315		419	0	(1)	(1)	(0,01)
	09.2023	$	99	ILS	352	0	(3)	(3)	(0,02)
	09.2023		207	PEN	759	1	0	1	0,01
	10.2023	MXN	3.739	$	200	0	(14)	(14)	(0,07)
	10.2023	TRY	498		18	0	0	0	0,00
BSH	08.2023	PEN	61		15	0	(2)	(2)	(0,01)
CBK	07.2023	CLP	593.276		733	0	(6)	(6)	(0,03)
	07.2023	€	231		248	0	(4)	(4)	(0,02)
	07.2023	PLN	1.113		266	0	(7)	(7)	(0,04)
	07.2023	TRY	4.990		222	32	0	32	0,16
	07.2023	$	65	BRL	310	0	0	0	0,00
	07.2023		84	COP	382.066	7	0	7	0,04
	07.2023		272	CZK	5.855	0	(3)	(3)	(0,01)
	07.2023		346	PHP	18.862	0	(5)	(5)	(0,02)
	07.2023		53	PLN	219	1	0	1	0,01
	07.2023		577	RON	2.609	0	(3)	(3)	(0,02)
	07.2023		35	UYU	1.325	0	0	0	0,00
	07.2023	UYU	2.928	$	76	0	(2)	(2)	(0,01)
	08.2023	BRL	454		88	0	(5)	(5)	(0,03)
	08.2023	CAD	20		15	0	0	0	0,00
	08.2023	COP	170.335		40	0	0	0	0,00
	08.2023	EGP	661		19	0	(2)	(2)	(0,01)
	08.2023	$	943	CLP	771.582	12	0	12	0,06
	08.2023		323	INR	26.736	2	0	2	0,01
	08.2023		9	NOK	89	0	0	0	0,00
	08.2023		60	PEN	236	4	0	4	0,02
	08.2023		208	TWD	6.360	0	(4)	(4)	(0,02)
	08.2023		30	ZAR	565	0	(1)	(1)	0,00
	09.2023	INR	26.736	$	323	0	(2)	(2)	(0,01)
	09.2023	KRW	5.215		4	0	0	0	0,00
	09.2023	MXN	2.471		133	0	(9)	(9)	(0,05)
	09.2023	PHP	5.715		101	0	(2)	(2)	(0,01)
	09.2023	$	704	IDR	10.510.877	0	(6)	(6)	(0,03)
	09.2023		220	INR	18.255	2	0	2	0,01
	09.2023	ZMW	159	$	9	0	0	0	0,00
	10.2023	CLP	5.926		7	0	0	0	0,00
	10.2023	$	5	NGN	2.985	0	(1)	(1)	(0,01)
	11.2023	ILS	492		149	16	0	16	0,08
	11.2023	$	86	EGP	2.763	0	(6)	(6)	(0,03)
	02.2024	EGP	325	$	9	0	0	0	0,00
	02.2024	$	31	EGP	1.071	0	(2)	(2)	(0,01)
DUB	07.2023	ILS	392	$	112	6	0	6	0,03
	07.2023	RON	188		42	1	0	1	0,00
	07.2023	$	626	BRL	3.394	78	0	78	0,38
	10.2023		14	NGN	8.028	0	(4)	(4)	(0,02)
	10.2023		1	ZAR	10	0	0	0	0,00
	11.2023	EGP	1.590	$	56	10	0	10	0,05
	01.2024	NGN	3.075		5	1	0	1	0,01
	01.2024	$	14	ZAR	285	0	0	0	0,00
	02.2024		128	EGP	4.495	0	(8)	(8)	(0,04)
GLM	07.2023	BRL	3.965	$	821	0	(1)	(1)	(0,01)
	07.2023	COP	67.560		16	0	0	0	0,00
	07.2023	DOP	909		16	0	(1)	(1)	0,00
	07.2023	EGP	973		31	0	(1)	(1)	0,00
	07.2023	RON	1.256		278	2	0	2	0,01
	07.2023	SGD	30		22	0	0	0	0,00
	07.2023	$	152	BRL	796	13	0	13	0,06
	07.2023		164	COP	694.514	2	0	2	0,01
	07.2023		65	CZK	1.393	0	(1)	(1)	(0,01)
	07.2023		29	EGP	953	2	0	2	0,01
	07.2023		275	MXN	4.837	7	0	7	0,03
	07.2023		3	PLN	11	0	0	0	0,00

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung		Zu erhaltende Währung		Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
	07.2023	$	277	RON	1.254	$ 0	$ (1)	$ (1)	(0,01)
	08.2023	BRL	457	$	91	0	(3)	(3)	(0,01)
	08.2023	CNH	622		90	4	0	4	0,02
	08.2023	DOP	15.568		274	0	(6)	(6)	(0,03)
	08.2023	$	149	DOP	8.574	5	0	5	0,02
	08.2023		4	NOK	40	0	0	0	0,00
	08.2023	ZAR	1.440	$	78	2	0	2	0,01
	09.2023	TRY	1.672		65	3	0	3	0,02
	09.2023	$	795	BRL	3.880	1	0	1	0,00
	09.2023		201	THB	6.923	0	(4)	(4)	(0,02)
	10.2023	DOP	5.562	$	99	1	0	1	0,00
	10.2023	NGN	14.944		27	8	0	8	0,04
	11.2023	EGP	1.593		56	10	0	10	0,05
	11.2023	€	145	PLN	652	0	0	0	0,00
	11.2023	$	12	EGP	365	0	(2)	(2)	(0,01)
	12.2023	DOP	1.336	$	24	1	0	1	0,00
	01.2024	EGP	1.105		29	0	(1)	(1)	0,00
IND	08.2023	CNH	293	$	41	1	0	1	0,01
	08.2023	$	10	NOK	101	0	0	0	0,00
	11.2023	€	21	HUF	9.727	5	0	5	0,02
	06.2024	$	82	TWD	2.110	0	(12)	(12)	(0,06)
	07.2023	$	43	BRL	212	1	0	1	0,01
JPM	07.2023	¥	1.254	$	0	0	0	0	0,00
	07.2023	PLN	92		22	0	(1)	(1)	0,00
	07.2023	TRY	1.977		80	4	0	4	0,02
	07.2023	$	43	BRL	212	1	0	1	
	07.2023		226	€	211	5	0	5	0,02
	07.2023		74	MXN	1.295	2	0	2	0,01
	07.2023		4	NGN	2.156	0	(1)	(1)	(0,01)
	07.2023		23	PHP	1.234	0	0	0	0,00
	07.2023		1.688	SGD	2.230	0	(39)	(39)	(0,20)
	08.2023	CAD	32	$	24	0	0	0	0,00
	08.2023	CHF	3		3	0	0	0	0,00
	08.2023	CNH	23		3	0	0	0	0,00
	08.2023	CNY	682		96	1	0	1	0,01
	08.2023	COP	100.220		24	0	0	0	0,00
	08.2023	HUF	70.754		203	0	(2)	(2)	(0,01)
	08.2023	MXN	1.933		112	0	0	0	0,00
	08.2023	$	96	CNH	684	0	(2)	(2)	(0,01)
	08.2023		373	CNY	2.554	0	(20)	(20)	(0,10)
	08.2023		12	EGP	412	1	0	1	0,00
	08.2023		9	¥	1.249	0	0	0	0,00
	08.2023		102	ZAR	1.994	3	0	3	0,02
	08.2023	ZAR	1.611	$	83	0	(2)	(2)	(0,01)
	09.2023	COP	63.315		15	0	0	0	0,00
	09.2023	PEN	594		161	0	(2)	(2)	(0,01)
	09.2023	$	95	ILS	338	0	(4)	(4)	(0,02)
	09.2023		32	INR	2.633	0	0	0	0,00
	09.2023		3	NGN	2.012	0	(1)	(1)	0,00
	09.2023		419	THB	14.363	0	(11)	(11)	(0,05)
	10.2023	MXN	1.584	$	90	0	0	0	0,00
	10.2023	$	7	NGN	4.093	0	(2)	(2)	(0,01)
	11.2023	HUF	9.736	€	21	0	(5)	(5)	(0,02)
	12.2023	NGN	3.105	$	5	1	0	1	0,01
	12.2023	$	6	NGN	3.792	0	(1)	(1)	(0,01)
	01.2024		32	EGP	1.065	0	(3)	(3)	(0,02)
	02.2024	EGP	455	$	12	0	0	0	0,00
	04.2024	KES	7.223		47	0	(1)	(1)	0,00
	06.2024	$	8	IDR	120.000	0	0	0	0,00
MBC	07.2023	€	55	$	60	0	(1)	(1)	0,00
	07.2023	£	103		127	0	(3)	(3)	(0,02)
	07.2023	PLN	8		2	0	0	0	0,00
	07.2023	$	76	COP	322.546	1	0	1	0,01
	08.2023	CNY	165	$	24	1	0	1	0,01
	08.2023	$	18	ZAR	353	0	0	0	0,00
	09.2023		40	INR	3.309	0	0	0	0,00
	09.2023		773	KRW	986.170	0	(22)	(22)	(0,11)
	01.2024		41	EGP	1.358	0	(4)	(4)	(0,02)
MYI	07.2023	CZK	2.186	$	101	1	0	1	0,00
	07.2023	MXN	396		22	0	(1)	(1)	(0,01)
	07.2023	MYR	63		14	0	0	0	0,00
	07.2023	PLN	407		97	0	(3)	(3)	(0,01)
	07.2023	$	199	COP	839.564	1	0	1	0,00
	07.2023		5	MYR	23	0	0	0	0,00
	07.2023		84	PLN	350	2	0	2	0,01
	08.2023	CHF	18	$	20	0	0	0	0,00
	08.2023	TWD	677		22	0	0	0	0,00
	08.2023	$	217	TWD	6.574	0	(6)	(6)	(0,03)
	08.2023		91	ZAR	1.773	2	0	2	0,01
	09.2023	TRY	878	$	33	0	0	0	0,00
	09.2023	$	128	IDR	1.912.383	0	(1)	(1)	(0,01)
	09.2023		866	KRW	1.108.296	0	(21)	(21)	(0,11)
	09.2023		191	THB	6.547	0	(5)	(5)	(0,03)
	10.2023	ZAR	19	$	1	0	0	0	0,00
	11.2023	EGP	210		6	0	0	0	0,00
	01.2024		654		18	0	0	0	0,00
	01.2024	NGN	3.075		5	1	0	1	0,01

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung		Zu erhaltende Währung		Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
	01.2024	$	31	EGP	1.035	$ 0	$ (3)	$ (3)	(0,01)
	02.2024	EGP	259	$	7	0	0	0	0,00
RBC	07.2023	MXN	1.413		73	0	(9)	(9)	(0,04)
	08.2023	$	1.546	MXN	26.789	4	0	4	0,02
RYL	07.2023	PLN	114	$	27	0	(1)	(1)	(0,01)
SCX	07.2023	NGN	2.635		5	2	0	2	0,01
	07.2023	TRY	2.302		100	12	0	12	0,06
	07.2023	$	11	€	10	0	0	0	0,00
	07.2023		40	KES	5.754	1	0	1	0,01
	07.2023		481	MYR	2.210	0	(7)	(7)	(0,03)
	07.2023		1	NGN	768	0	0	0	0,00
	08.2023	NZD	24	$	15	0	0	0	0,00
	08.2023	TWD	533		17	0	0	0	0,00
	08.2023	$	22	CNH	157	0	(1)	(1)	0,00
	08.2023		993	CNY	6.782	0	(55)	(55)	(0,27)
	09.2023	CLP	19.358	$	24	0	0	0	0,00
	09.2023	TWD	1		0	0	0	0	0,00
	09.2023	$	124	IDR	1.857.507	0	0	0	0,00
	09.2023		2.055	INR	170.362	16	0	16	0,08
	09.2023		430	THB	14.863	0	(8)	(8)	(0,04)
	09.2023		335	TWD	10.199	0	(6)	(6)	(0,03)
	11.2023	EGP	219	$	6	0	0	0	0,00
	11.2023	$	30	EGP	1.165	4	0	4	0,02
	12.2023		21	KES	3.089	0	0	0	0,00
	01.2024		0	EGP	13	0	0	0	0,00
	01.2024		7	NGN	5.754	0	0	0	0,00
	06.2024	KES	3.226	$	21	0	0	0	0,00
SOG	07.2023	€	346		372	0	(5)	(5)	(0,03)
	07.2023	SGD	167		126	3	0	3	0,01
	07.2023	$	1.110	PLN	4.781	66	0	66	0,33
	07.2023		29	RON	130	0	(1)	(1)	0,00
	01.2024		18	EGP	586	0	(2)	(2)	(0,01)
SSB	07.2023	BRL	579	$	115	0	(5)	(5)	(0,02)
	07.2023	$	740	CLP	594.127	0	0	0	0,00
	08.2023	CLP	595.843	$	740	0	0	0	0,00
	09.2023	KRW	2.546.459		1.997	56	0	56	0,28
	09.2023	$	15	CLP	12.283	0	0	0	0,00
TOR	07.2023		109	£	86	0	0	0	0,00
	08.2023	£	86	$	109	0	0	0	0,00
	08.2023	HUF	44.197		126	0	(2)	(2)	(0,01)
UAG	07.2023	COP	817.577		196	1	0	1	0,00
	07.2023	$	995	TRY	22.932	0	(123)	(123)	(0,61)
	08.2023		28	CAD	38	1	0	1	0,00
	08.2023		18	CNH	122	0	(1)	(1)	0,00
	08.2023		196	COP	823.851	0	0	0	0,00
	08.2023	ZAR	618	$	33	0	0	0	0,00
	09.2023	SGD	301		225	2	0	2	0,01
	09.2023	$	54	ILS	193	0	(2)	(2)	(0,01)
	10.2023		53	ZAR	974	0	(2)	(2)	(0,01)
	11.2023	CZK	3.820	€	156	0	(3)	(3)	(0,01)
						$ 598	$ (649)	$ (51)	(0,25)
Summe Freiverkehrsfinanzderivate								**$ 218**	**1,09**

BESCHREIBUNG		PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
EINLAGENZERTIFIKATE				
Banco Davivienda S.A.				
13,501 % fällig am 13.12.2024	COP	91.000	$ 22	0,11
15,389 % fällig am 21.02.2024		30.000	7	0,04
BanColombia S.A.				
5,917 % fällig am 27.01.2024		141.800	34	0,16
13,320 % fällig am 08.06.2025		47.000	11	0,05
13,637 % fällig am 14.12.2024		124.000	30	0,15
16,137 % fällig am 01.09.2024		51.000	12	0,06
BBVA Colombia S.A.				
5,870 % fällig am 15.07.2024		104.000	23	0,12
14,540 % fällig am 13.01.2024		58.400	14	0,07
Summe Einlagenzertifikate			**$ 153**	**0,76**
Summe Anlagen			**$ 19.999**	**99,58**
Sonstige Aktiva und Passiva			**$ 84**	**0,42**
Nettovermögen			**$ 20.083**	**100,00**

ERLÄUTERUNGEN ZUR AUFSTELLUNG DES WERTPAPIERBESTANDS (Angaben in Tausend*):

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

^ **Das Wertpapier ist in Verzug.**

(a) Das Wertpapier hat in den letzten zwölf Monaten keine Erträge geliefert.

(b) Nullkuponwertpapier.

(c) Der Kupon stellt eine Rendite bis zur Endfälligkeit dar.

(d) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

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

(f) Mit dem Fonds verbunden.

(g) Bedingt wandelbares Wertpapier.

(h) Eingeschränkte Wertpapiere (31. Dezember 2022: 0,99 %):

Emittentenbeschreibung	Kauf-datum	Kosten	Markt-wert	% des Nettovermögens
Development Bank of Southern Africa 8,600 % fällig am 21.10.2024	07.10.2021	$ 215	$ 167	0,83
DrillCo Holding Lux S.A.	08.06.2023	16	15	0,08
Flourish Century 6,600 % fällig am 04.02.2022	25.08.2021	197	22	0,11
		$ 428	$ 204	1,02

Barmittel in Höhe von 273 USD (31. Dezember 2022: 282 USD) wurden zum 30. Juni 2023 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Beizulegender Zeitwert[1]

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 30. Juni 2023 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie[2]	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	$ 0	$ 17.095	$ 258	$ 17.353
Investmentfonds	1.960	0	0	1.960
Pensionsgeschäfte	0	150	0	150
Finanzderivate[3]	2	381	0	383
Einlagen bei Kreditinstituten	0	54	99	153
Summen	**$ 1.962**	**$ 17.680**	**$ 357**	**$ 19.999**

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

Kategorie[2]	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	$ 0	$ 15.014	$ 250	$ 15.264
Investmentfonds	205	1.853	0	2.058
Pensionsgeschäfte	0	2.766	0	2.766
Finanzderivate[3]	0	993	0	993
Einlagen bei Kreditinstituten	0	34	44	78
Summen	**$ 205**	**$ 20.660**	**$ 294**	**$ 21.159**

(1) Weitere Informationen finden Sie in den Erläuterungen in Erläuterung 3.

(2) Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung des Wertpapierbestands.

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

Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC-Finanzderivate und -Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2023 und 31. Dezember 2022:

	Zum 30. Jun. 2023			Zum 31. Dez. 2022		
Kontrahent	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-engagement[1]	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-engagement[1]
BOA	$ 15	$ 0	$ 15	$ 95	$ 0	$ 95
BPS	56	0	56	(152)	0	(152)
BRC	(26)	0	(26)	21	0	21
BSH	(2)	0	(2)	k. A.	k. A.	k. A.
CBK	6	0	6	98	0	98
CLY	k. A.	k. A.	k. A.	(4)	0	(4)
DUB	84	0	84	13	0	13
GLM	280	(270)	10	404	(270)	134
GST	3	0	3	k. A.	k. A.	k. A.
IND	(6)	0	(6)	(9)	0	(9)
JPM	(73)	0	(73)	49	0	49
MBC	(28)	0	(28)	(34)	0	(34)
MYC	k. A.	k. A.	k. A.	(14)	0	(14)
MYI	(30)	0	(30)	25	0	25
RBC	(5)	0	(5)	1	0	1
RYL	(1)	0	(1)	k. A.	k. A.	k. A.
SCX	(42)	0	(42)	124	0	124

	Zum 30. Jun. 2023			Zum 31. Dez. 2022		
Kontrahent	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-engagement[1]	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-engagement[1]
SOG	$ 61	$ 0	$ 61	$ 38	$ 0	$ 38
SSB	51	0	51	k. A.	k. A.	k. A.
TOR	(2)	0	(2)	(213)	0	(213)
UAG	(123)	0	(123)	116	0	116

[1] Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären.

Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung des Wertpapierbestands zum 30. Juni 2023:

	30. Jun. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	69,29	27,93
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	17,00	44,26
Sonstige übertragbare Wertpapiere	0,11	0,70
Investmentfonds	9,76	9,83
Pensionsgeschäfte	0,75	13,22
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	0,01	0,09
Zentral abgerechnete Finanzderivate	0,81	1,99
Freiverkehrsfinanzderivate	1,09	2,67
Einlagenzertifikate	0,76	0,37

Das Anlageportfolio des Fonds konzentriert sich zum 30. Juni 2023 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	30. Jun. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
Argentinien	k. A.	0,22
Aserbaidschan	0,97	0,93
Brasilien	2,90	2,81
Cayman-Inseln	0,07	0,21
Chile	0,58	0,03
China	0,53	0,11
Kolumbien	0,61	1,99
Tschechische Republik	1,03	0,85
Dänemark	0,00	1,89
Dominikanische Republik	1,59	0,31
Ungarn	1,87	0,93
Indonesien	0,02	0,00
Irland	1,51	1,52
Israel	2,18	2,07
Jersey, Kanalinseln	0,54	0,51
Luxemburg	0,23	0,13
Malaysia	6,38	k. A.
Mauritius	k. A.	0,87
Mexiko	4,11	1,62
Niederlande	0,03	0,05
Peru	2,36	1,60
Polen	1,10	0,37
Rumänien	0,09	k. A.
Katar	k. A.	0,45
Südafrika	3,47	3,99
Großbritannien	0,62	1,48
USA	5,44	5,71
Uruguay	0,32	k. A.
Sambia	0,08	0,13
Kurzfristige Instrumente	47,77	42,11
Investmentfonds	9,76	9,83
Pensionsgeschäfte	0,75	13,22
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	0,01	0,09
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen — Schutzverkauf	k. A.	0,00
Zinsswaps	0,81	1,99
Freiverkehrsfinanzderivate		
Optionskauf		
Devisenoptionen	0,33	0,13
Straddle-Optionen	0,00	k. A.
Verkaufsoptionen		
Devisenoptionen	(0,10)	0,00
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen — Schutzkauf	0,02	k. A.
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen — Schutzverkauf	0,00	0,00
Cross-Currency Swaps	1,10	1,01
Zinsswaps	(0,01)	0,00
Volatilitätsswaps	k. A.	0,00
Devisenterminkontrakte	(0,25)	1,53
Einlagenzertifikate	0,76	0,37
Sonstige Aktiva und Passiva	0,42	(1,06)
Nettovermögen	100,00	100,00

BESCHREIBUNG		PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE				
KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG				
Wm Morrison Supermarkets Ltd.				
8,073 % fällig am 04.11.2027	€	800	$ 751	0,29
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
BANKEN UND FINANZEN				
ABN AMRO Bank NV				
2,470 % fällig am 13.12.2029	$	400	335	0,13
Acef Holding S.C.A.				
0,750 % fällig am 14.06.2028	€	100	89	0,03
1,250 % fällig am 26.04.2030		300	251	0,10
AIB Group PLC				
2,875 % fällig am 30.05.2031		400	396	0,16
Ally Financial, Inc.				
2,200 % fällig am 02.11.2028	$	600	479	0,19
8,000 % fällig am 01.11.2031		350	364	0,14
American Express Co.				
4,050 % fällig am 03.05.2029		500	477	0,19
American Tower Corp.				
3,100 % fällig am 15.06.2050		200	131	0,05
3,800 % fällig am 15.08.2029		150	137	0,05
Asian Development Bank				
6,550 % fällig am 26.01.2025	ZAR	42.000	2.130	0,84
Banco BTG Pactual S.A.				
2,750 % fällig am 11.01.2026	$	600	548	0,22
Banco de Sabadell S.A.				
0,875 % fällig am 16.06.2028	€	100	92	0,04
Banco Mercantil del Norte S.A.				
6,625 % fällig am 24.01.2032 (e)(f)	$	200	155	0,06
BanColombia S.A.				
3,000 % fällig am 29.01.2025		600	570	0,22
Bank Mandiri Persero Tbk PT				
2,000 % fällig am 19.04.2026		200	181	0,07
Bank of America Corp.				
2,687 % fällig am 22.04.2032		1.100	912	0,36
6,204 % fällig am 10.11.2028		300	309	0,12
Bank of Ireland Group PLC				
4,875 % fällig am 16.07.2028	€	500	545	0,21
7,594 % fällig am 06.12.2032	£	400	487	0,19
Banque Ouest Africaine de Developpement				
2,750 % fällig am 22.01.2033	€	470	374	0,15
Barclays PLC				
4,836 % fällig am 09.05.2028	$	400	369	0,14
5,501 % fällig am 09.08.2028		500	488	0,19
7,750 % fällig am 15.09.2023 (e)(f)		200	197	0,08
BNP Paribas S.A.				
1,675 % fällig am 30.06.2027		400	353	0,14
4,625 % fällig am 25.02.2031 (e)(f)		200	143	0,06
7,750 % fällig am 16.08.2029 (e)(f)		800	776	0,30
Boston Properties LP				
2,550 % fällig am 01.04.2032		400	302	0,12
BPCE S.A.				
2,045 % fällig am 19.10.2027		300	262	0,10
Brookfield Finance UK PLC				
2,340 % fällig am 30.01.2032		550	429	0,17
CaixaBank S.A.				
3,625 % fällig am 14.09.2028 (e)(f)	€	200	149	0,06
3,750 % fällig am 07.09.2029		300	324	0,13
6,208 % fällig am 18.01.2029	$	500	499	0,20
Castellum Helsinki Finance Holding Abp				
0,875 % fällig am 17.09.2029	€	300	224	0,09
CBRE Global Investors Open-Ended Fund S.C.A. SICAV-SIF Pan European Core Fund				
0,900 % fällig am 12.10.2029		500	399	0,16
Citigroup, Inc.				
2,976 % fällig am 05.11.2030	$	200	173	0,07
5,746 % fällig am 25.01.2026 (g)		500	498	0,20
Citycon Treasury BV				
1,625 % fällig am 12.03.2028	€	300	239	0,09
CNP Assurances				
1,250 % fällig am 27.01.2029		400	361	0,14
Cooperatieve Rabobank UA				
1,004 % fällig am 24.09.2026	$	900	804	0,32
Corporate Office Properties LP				
2,000 % fällig am 15.01.2029	$	100	$ 76	0,03
CPI Property Group S.A.				
1,750 % fällig am 14.01.2030	€	300	199	0,08
2,750 % fällig am 22.01.2028	£	300	255	0,10
Credit Agricole Assurances S.A.				
1,500 % fällig am 06.10.2031	€	200	166	0,07
Crown Castle, Inc.				
3,100 % fällig am 15.11.2029	$	550	480	0,19
CTP NV				
1,250 % fällig am 21.06.2029	€	400	317	0,12
1,500 % fällig am 27.09.2031		400	305	0,12
Deutsche Bank AG				
3,035 % fällig am 28.05.2032 (g)	$	350	276	0,11
3,742 % fällig am 07.01.2033		500	367	0,14
6,720 % fällig am 18.01.2029		500	501	0,20
7,079 % fällig am 10.02.2034		500	463	0,18
Digital Dutch Finco BV				
0,625 % fällig am 15.07.2025	€	600	596	0,23
1,000 % fällig am 15.01.2032		500	386	0,15
EQT AB				
0,875 % fällig am 14.05.2031		600	467	0,18
2,375 % fällig am 06.04.2028		700	674	0,26
Equinix, Inc.				
2,500 % fällig am 15.05.2031	$	50	41	0,02
3,900 % fällig am 15.04.2032		260	234	0,09
Equitable Financial Life Global Funding				
1,800 % fällig am 08.03.2028		700	591	0,23
First American Financial Corp.				
2,400 % fällig am 15.08.2031		600	457	0,18
Ford Motor Credit Co. LLC				
4,687 % fällig am 09.06.2025		200	193	0,08
5,584 % fällig am 18.03.2024		200	199	0,08
FS KKR Capital Corp.				
3,125 % fällig am 12.10.2028		450	367	0,14
Globalworth Real Estate Investments Ltd.				
2,950 % fällig am 29.07.2026	€	400	329	0,13
Goldman Sachs Group, Inc.				
2,383 % fällig am 21.07.2032	$	800	641	0,25
Goodman U.S. Finance Five LLC				
4,625 % fällig am 04.05.2032		700	644	0,25
Goodman U.S. Finance Three LLC				
3,700 % fällig am 15.03.2028		500	454	0,18
GPT Wholesale Office Fund				
3,222 % fällig am 05.11.2031	AUD	400	207	0,08
Grainger PLC				
3,000 % fällig am 03.07.2030	£	100	96	0,04
Hanwha Life Insurance Co. Ltd.				
3,379 % fällig am 04.02.2032	$	300	269	0,11
HAT Holdings LLC				
3,375 % fällig am 15.06.2026		610	547	0,21
3,750 % fällig am 15.09.2030		230	181	0,07
Host Hotels & Resorts LP				
2,900 % fällig am 15.12.2031		100	79	0,03
3,375 % fällig am 15.12.2029		800	684	0,27
3,500 % fällig am 15.09.2030		240	204	0,08
Howard Hughes Corp.				
4,375 % fällig am 01.02.2031		700	559	0,22
HSBC Holdings PLC				
3,973 % fällig am 22.05.2030		200	180	0,07
4,583 % fällig am 19.06.2029		500	471	0,18
6,254 % fällig am 09.03.2034		600	615	0,24
Hudson Pacific Properties LP				
3,950 % fällig am 01.11.2027		250	182	0,07
5,950 % fällig am 15.02.2028		150	119	0,05
ING Groep NV				
4,125 % fällig am 24.08.2033	€	300	309	0,12
4,250 % fällig am 16.05.2031 (e)(f)	$	200	134	0,05
4,875 % fällig am 16.05.2029 (e)(f)		700	544	0,21
Internationale Bank für Wiederaufbau und Entwicklung				
3,000 % fällig am 27.09.2023		10.950	8 10.88	4,27
Intesa Sanpaolo SpA				
4,198 % fällig am 01.06.2032		200	149	0,06
5,017 % fällig am 26.06.2024		200	194	0,08
6,625 % fällig am 31.05.2033	£	600	733	0,29
6,625 % fällig am 20.06.2033	$	500	499	0,20
JAB Holdings BV				
5,000 % fällig am 12.06.2033	€	200	$ 222	0,09
KBC Group NV				
5,796 % fällig am 19.01.2029	$	1.250	1.243	0,49
Kilroy Realty LP				
2,500 % fällig am 15.11.2032		640	445	0,17
2,650 % fällig am 15.11.2033		200	136	0,05
Kookmin Bank				
2,500 % fällig am 04.11.2030 (f)		200	162	0,06
Lendlease Finance Ltd.				
3,400 % fällig am 27.10.2027	AUD	1.100	643	0,25
Logicor Financing SARL				
2,000 % fällig am 17.01.2034	€	500	363	0,14
Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc.				
2,494 % fällig am 13.10.2032	$	700	563	0,22
5,475 % fällig am 22.02.2031		800	796	0,31
Mizuho Financial Group, Inc.				
2,201 % fällig am 10.07.2031		800	641	0,25
Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG in Muenchen				
5,875 % fällig am 23.05.2042		400	402	0,16
Nationstar Mortgage Holdings, Inc.				
5,750 % fällig am 15.11.2031		300	247	0,10
NE Property BV				
2,000 % fällig am 20.01.2030	€	200	161	0,06
3,375 % fällig am 14.07.2027		300	294	0,12
New Immo Holding S.A.				
2,750 % fällig am 26.11.2026		200	196	0,08
Nexi SpA				
1,625 % fällig am 30.04.2026		259	258	0,10
Nomura Holdings, Inc.				
2,172 % fällig am 14.07.2028	$	600	507	0,20
OneMain Finance Corp.				
3,500 % fällig am 15.01.2027		826	710	0,28
PennyMac Financial Services, Inc.				
5,750 % fällig am 15.09.2031		200	163	0,06
Protective Life Global Funding				
1,737 % fällig am 21.09.2030		800	628	0,25
Rayonier LP				
2,750 % fällig am 17.05.2031		600	483	0,19
Reinsurance Group of America, Inc.				
6,000 % fällig am 15.09.2033		200	201	0,08
Rexford Industrial Realty LP				
2,150 % fällig am 01.09.2031		100	78	0,03
Santander Holdings USA, Inc.				
5,807 % fällig am 09.09.2026		800	786	0,31
Santander UK Group Holdings PLC				
3,823 % fällig am 03.11.2028		200	180	0,07
6,534 % fällig am 10.01.2029		400	403	0,16
Segro Capital SARL				
1,875 % fällig am 23.03.2030	€	250	229	0,09
Sirius Real Estate Ltd.				
1,125 % fällig am 22.06.2026		400	361	0,14
1,750 % fällig am 24.11.2028		200	156	0,06
SLM Corp.				
3,125 % fällig am 02.11.2026	$	900	779	0,31
Societe Generale S.A.				
4,750 % fällig am 26.05.2026 (e)(f)		200	159	0,06
6,691 % fällig am 10.01.2034		1.000	1.019	0,40
Sofina S.A.				
1,000 % fällig am 23.09.2028	€	200	175	0,07
Standard Chartered PLC				
2,678 % fällig am 29.06.2032	$	500	392	0,15
3,603 % fällig am 12.01.2033 (g)		200	160	0,06
6,301 % fällig am 09.01.2029		700	704	0,28
SVB Financial Group				
4,570 % fällig am 29.04.2033 ^		370	248	0,10
Svenska Handelsbanken AB				
4,750 % fällig am 01.03.2031 (e)(f)		200	155	0,06
UBS Group AG				
4,375 % fällig am 10.02.2031 (e)(f)		200	141	0,06
5,959 % fällig am 12.01.2034		400	398	0,16
UniCredit SpA				
5,459 % fällig am 30.06.2035		300	255	0,10
VIA Outlets BV				
1,750 % fällig am 15.11.2028	€	500	439	0,17

BESCHREIBUNG		PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
Vonovia SE				
1,875 % fällig am 28.06.2028	€	200	$ 186	0,07
2,375 % fällig am 25.03.2032		200	178	0,07
Weyerhaeuser Co.				
7,375 % fällig am 15.03.2032	$	85	95	0,04
Workspace Group PLC				
2,250 % fällig am 11.03.2028	£	500	466	0,18
ZF Finance GmbH				
2,000 % fällig am 06.05.2027	€	400	381	0,15
2,250 % fällig am 03.05.2028		100	92	0,04
			61.551	24,17
INDUSTRIEWERTE				
Accor S.A.				
2,375 % fällig am 29.11.2028		900	884	0,35
Amgen, Inc.				
5,600 % fällig am 02.03.2043	$	900	903	0,35
Arcadis NV				
4,875 % fällig am 28.02.2028	€	200	218	0,09
Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC				
3,000 % fällig am 01.09.2029		600	489	0,19
Ball Corp.				
3,125 % fällig am 15.09.2031	$	580	478	0,19
BCP Modular Services Finance PLC				
4,750 % fällig am 30.11.2028	€	100	93	0,04
Boise Cascade Co.				
4,875 % fällig am 01.07.2030	$	380	344	0,13
CDW LLC				
3,569 % fällig am 01.12.2031		500	423	0,17
Cellnex Finance Co. S.A.				
3,875 % fällig am 07.07.2041		200	147	0,06
Centene Corp.				
3,000 % fällig am 15.10.2030		600	501	0,20
Fair Isaac Corp.				
4,000 % fällig am 15.06.2028		610	560	0,22
Flex Ltd.				
6,000 % fällig am 15.01.2028		300	305	0,12
Ford Motor Co.				
3,250 % fällig am 12.02.2032		80	63	0,02
Forvia				
2,750 % fällig am 15.02.2027	€	500	495	0,19
Gap, Inc.				
3,625 % fällig am 01.10.2029	$	200	142	0,06
3,875 % fällig am 01.10.2031		300	206	0,08
GN Store Nord A/S				
0,875 % fällig am 25.11.2024	€	400	407	0,16
Graphic Packaging International LLC				
2,625 % fällig am 01.02.2029		400	385	0,15
HCA, Inc.				
4,500 % fällig am 15.02.2027	$	500	483	0,19
Hilton Domestic Operating Co., Inc.				
3,625 % fällig am 15.02.2032		380	317	0,12
4,000 % fällig am 01.05.2031		200	174	0,07
InterContinental Hotels Group PLC				
3,375 % fällig am 08.10.2028	£	500	540	0,21
JCDecaux SE				
1,625 % fällig am 07.02.2030	€	300	269	0,10
JDE Peet's NV				
2,250 % fällig am 24.09.2031	$	600	465	0,18
John Lewis PLC				
6,125 % fällig am 21.01.2025	£	200	245	0,10
Lendlease Europe Finance PLC				
3,500 % fällig am 02.12.2033		164	136	0,05
Lenovo Group Ltd.				
3,421 % fällig am 02.11.2030	$	400	337	0,13
Liberty Utilities Finance GP				
2,050 % fällig am 15.09.2030		300	233	0,09
Lindblad Expeditions LLC				
6,750 % fällig am 15.02.2027		300	286	0,11
Marks & Spencer PLC				
4,500 % fällig am 10.07.2027	£	350	394	0,15
Metalsa S.A. de C.V.				
3,750 % fällig am 04.05.2031	$	150	118	0,05
MSCI, Inc.				
3,625 % fällig am 01.09.2030		400	345	0,13
Nemak S.A.B. de C.V.				
2,250 % fällig am 20.07.2028	€	400	$ 355	0,14
Newell Brands, Inc.				
4,875 % fällig am 01.06.2025	$	200	193	0,08
NXP BV				
2,500 % fällig am 11.05.2031		250	204	0,08
5,000 % fällig am 15.01.2033		1.000	961	0,38
Pearson Funding PLC				
3,750 % fällig am 04.06.2030	£	100	108	0,04
RELX Capital, Inc.				
4,750 % fällig am 20.05.2032	$	800	785	0,31
ReNew Power Pvt Ltd.				
5,875 % fällig am 05.03.2027		200	187	0,07
S&P Global, Inc.				
2,700 % fällig am 01.03.2029		700	631	0,25
Schaeffler AG				
3,375 % fällig am 12.10.2028	€	200	200	0,08
SK Hynix, Inc.				
6,375 % fällig am 17.01.2028	$	600	603	0,24
Standard Industries, Inc.				
2,250 % fällig am 21.11.2026	€	600	583	0,23
Tesco Corporate Treasury Services PLC				
0,375 % fällig am 27.07.2029		300	263	0,10
Teva Pharmaceutical Finance Netherlands BV				
7,875 % fällig am 15.09.2031		400	452	0,18
Transurban Finance Co. Pty. Ltd.				
2,450 % fällig am 16.03.2031	$	500	410	0,16
Travis Perkins PLC				
3,750 % fällig am 17.02.2026	£	400	458	0,18
VeriSign, Inc.				
2,700 % fällig am 15.06.2031	$	650	541	0,21
Vilmorin & Cie S.A.				
1,375 % fällig am 26.03.2028	€	300	257	0,10
Vmed O2 UK Financing PLC				
4,500 % fällig am 15.07.2031	£	200	194	0,08
4,750 % fällig am 15.07.2031	$	600	500	0,20
Wabtec Transportation Netherlands BV				
1,250 % fällig am 03.12.2027	€	400	379	0,15
Weir Group PLC				
2,200 % fällig am 13.05.2026	$	400	358	0,14
Zenith Finco PLC				
6,500 % fällig am 30.06.2027	£	200	194	0,08
ZF North America Capital, Inc.				
6,875 % fällig am 14.04.2028	$	150	152	0,06
			20.353	7,99
VERSORGUNGSUNTERNEHMEN				
AES Corp.				
2,450 % fällig am 15.01.2031		300	243	0,10
5,450 % fällig am 01.06.2028		700	688	0,27
CenterPoint Energy Houston Electric LLC				
5,300 % fällig am 01.04.2053		800	819	0,32
Clean Renewable Power Mauritius Pte. Ltd.				
4,250 % fällig am 25.03.2027		186	163	0,06
Enel Finance America LLC				
7,100 % fällig am 14.10.2027		800	841	0,33
Enel Finance International NV				
1,375 % fällig am 12.07.2026		300	265	0,10
2,250 % fällig am 12.07.2031		400	314	0,12
Greenko Solar Mauritius Ltd.				
5,950 % fällig am 29.07.2026		200	188	0,07
Iberdrola International BV				
6,750 % fällig am 15.09.2033		250	265	0,10
India Green Energy Holdings				
5,375 % fällig am 29.04.2024		250	244	0,10
India Green Power Holdings				
4,000 % fällig am 22.02.2027		250	219	0,09
National Grid PLC				
0,250 % fällig am 01.09.2028	€	400	362	0,14
NextEra Energy Capital Holdings, Inc.				
1,900 % fällig am 15.06.2028	$	400	343	0,14
2,200 % fällig am 02.12.2026	AUD	400	240	0,10
Pacific Gas & Electric Co.				
6,700 % fällig am 01.04.2053	$	1.300	1.278	0,50
PacifiCorp				
5,350 % fällig am 01.12.2053	$	700	$ 640	0,25
Pattern Energy Operations LP				
4,500 % fällig am 15.08.2028		500	457	0,18
Southern California Edison Co.				
2,500 % fällig am 01.06.2031		400	333	0,13
3,650 % fällig am 01.06.2051		200	149	0,06
Star Energy Geothermal Wayang Windu Ltd.				
6,750 % fällig am 24.04.2033		324	319	0,13
TDC Net A/S				
5,056 % fällig am 31.05.2028	€	300	322	0,13
5,618 % fällig am 06.02.2030		2.700	2.893	1,14
TerraForm Power Operating LLC				
5,000 % fällig am 31.01.2028	$	230	212	0,08
Verizon Communications, Inc.				
2,850 % fällig am 03.09.2041		300	214	0,08
5,050 % fällig am 09.05.2033		1.500	1.484	0,58
Vodafone Group PLC				
5,125 % fällig am 04.06.2081		113	82	0,03
			13.577	5,33
Summe Unternehmensanleihen und Wechsel			95.481	37,49
US-REGIERUNGSBEHÖRDEN				
Fannie Mae				
3,500 % fällig am 01.08.2059		3.138	2.864	1,12
4,000 % fällig am 01.11.2059		135	128	0,05
Ginnie Mae, TBA				
5,000 % fällig am 01.07.2053		2.500	2.457	0,97
Uniform Mortgage-Backed Security				
3,000 % fällig am 01.07.2052		492	433	0,17
4,000 % fällig am 01.05.2053		1.541	1.446	0,57
4,500 % fällig am 01.07.2052 - 01.06.2053		2.599	2.501	0,98
5,500 % fällig am 01.06.2053		21.763	21.696	8,52
Uniform Mortgage-Backed Security, TBA				
2,000 % fällig am 01.08.2053		500	408	0,16
2,500 % fällig am 01.07.2053		0	0	0,00
3,500 % fällig am 01.08.2053		800	730	0,29
4,000 % fällig am 01.07.2053		18.950	17.786	6,98
4,500 % fällig am 01.07.2053		5.300	5.098	2,00
5,000 % fällig am 01.08.2053		23.800	23.326	9,16
5,500 % fällig am 01.07.2053		14.100	14.031	5,51
6,000 % fällig am 01.08.2053		7.400	7.464	2,93
6,500 % fällig am 01.07.2053		5.500	5.614	2,20
			105.982	41,61
US-SCHATZOBLIGATIONEN				
U.S. Treasury Inflation Protected Securities (d)				
0,125 % fällig am 15.07.2024		1.763	1.710	0,67
0,125 % fällig am 15.10.2024		1.998	1.927	0,76
0,125 % fällig am 15.07.2031		1.403	1.245	0,49
0,125 % fällig am 15.01.2032		6.784	5.975	2,34
0,250 % fällig am 15.01.2025		2.561	2.456	0,96
0,500 % fällig am 15.04.2024		48	47	0,02
0,625 % fällig am 15.01.2024		1.079	1.061	0,42
0,750 % fällig am 15.02.2045		206	170	0,07
1,000 % fällig am 15.02.2046		525	456	0,18
1,375 % fällig am 15.02.2044		820	773	0,30
U.S. Treasury Notes				
2,375 % fällig am 31.03.2029		2.100	1.918	0,75
3,875 % fällig am 30.09.2029		2.400	2.377	0,94
			20.115	7,90
NON-AGENCY-MBS				
1211 Avenue of the Americas Trust				
4,280 % fällig am 10.08.2035		1.895	1.661	0,65
225 Liberty Street Trust				
4,501 % fällig am 10.02.2036		1.200	999	0,39
245 Park Avenue Trust				
3,779 % fällig am 05.06.2037		1.250	1.030	0,40
280 Park Avenue Mortgage Trust				
6,262 % fällig am 15.09.2034		2.297	2.144	0,84
Banc of America Funding Trust				
6,479 % fällig am 25.10.2036		63	54	0,02
Barclays Commercial Mortgage Securities Trust				
0,749 % fällig am 10.08.2033 (a)		9.200	105	0,04

BESCHREIBUNG		PAR (000S)		MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
4,216 % fällig am 10.08.2033	$	105	$	92	0,04
4,498 % fällig am 10.08.2035		1.600		1.413	0,55
4,715 % fällig am 10.08.2033		2.190		1.720	0,67
5,122 % fällig am 10.08.2035		550		451	0,18
Bear Stearns ALT-A Trust					
5,470 % fällig am 25.06.2046 ^		790		682	0,27
Bridgegate Funding PLC					
8,466 % fällig am 16.10.2062	£	950		1.196	0,47
9,466 % fällig am 16.10.2062		950		1.192	0,47
Commercial Mortgage Trust					
3,960 % fällig am 10.02.2036	$	3.000		2.612	1,03
Downey Savings & Loan Association Mortgage Loan Trust					
5,297 % fällig am 19.03.2037		1.290		1.089	0,43
EMF-UK PLC					
5,970 % fällig am 13.03.2046	£	3.250		4.093	1,61
Great Hall Mortgages PLC					
5,282 % fällig am 18.06.2038		2.040		2.514	0,99
Independence Plaza Trust					
3,763 % fällig am 10.07.2035	$	345		322	0,13
3,911 % fällig am 10.07.2035		1.940		1.797	0,71
4,158 % fällig am 10.07.2035		132		122	0,05
4,356 % fällig am 10.07.2035		1.050		944	0,37
Madison Avenue Mortgage Trust					
3,478 % fällig am 15.08.2034		690		588	0,23
3,600 % fällig am 15.08.2034		225		185	0,07
4,108 % fällig am 15.08.2034		1.900		1.510	0,59
MortgageIT Trust					
5,750 % fällig am 25.08.2035		358		341	0,13
Natixis Commercial Mortgage Securities Trust					
3,917 % fällig am 15.11.2032		1.220		1.016	0,40
Residential Accredit Loans, Inc. Trust					
5,530 % fällig am 25.12.2036		75		66	0,03
Residential Funding Mortgage Securities, Inc. Trust					
4,573 % fällig am 25.04.2037		43		34	0,01
Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust					
5,795 % fällig am 25.04.2035		49		46	0,02
Towd Point Mortgage Funding PLC					
5,161 % fällig am 20.10.2051	£	3.000		3.775	1,48
WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust					
3,342 % fällig am 25.11.2036 ^	$	87	$	75	0,03
Worldwide Plaza Trust					
3,715 % fällig am 10.11.2036		1.795		1.173	0,46
				35.041	13,76

FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE

BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
Ameriquest Mortgage Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates			
6,200 % fällig am 25.05.2035	1.275	1.148	0,45
Argent Securities Trust			
5,450 % fällig am 25.06.2036	2.021	604	0,24
Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust			
5,650 % fällig am 25.08.2036	1.287	1.160	0,46
6,275 % fällig am 25.02.2035	61	60	0,02
BNC Mortgage Loan Trust			
3,821 % fällig am 25.10.2036	104	75	0,03
Centex Home Equity Loan Trust			
6,065 % fällig am 25.10.2035	41	41	0,02
Countrywide Asset-Backed Certificates Trust			
5,290 % fällig am 25.06.2047 ^	70	62	0,02
5,670 % fällig am 25.12.2036 ^	305	286	0,11
First Franklin Mortgage Loan Trust			
4,234 % fällig am 25.03.2036	1.447	1.285	0,51
5,900 % fällig am 25.12.2035	968	920	0,36
GoodLeap Sustainable Home Solutions Trust			
5,520 % fällig am 22.02.2055	677	646	0,25
GSAMP Trust			
5,630 % fällig am 25.06.2036	1.837	979	0,38
6,050 % fällig am 25.11.2035 ^	100	94	0,04
JPMorgan Mortgage Acquisition Trust			
4,459 % fällig am 25.01.2037	4.250	2.327	0,91
Lehman XS Trust			
5,470 % fällig am 25.02.2037	598	577	0,23
Long Beach Mortgage Loan Trust			
5,450 % fällig am 25.11.2036	516	372	0,15
5,460 % fällig am 25.08.2036	2.555	1.382	0,54
Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust			
5,825 % fällig am 25.09.2035	500	464	0,18
Mosaic Solar Loans LLC			
4,450 % fällig am 20.06.2042	$ 486	$ 459	0,18
Soundview Home Loan Trust			
5,650 % fällig am 25.10.2036	591	552	0,22
Structured Asset Investment Loan Trust			
6,125 % fällig am 25.05.2035	1.405	1.205	0,47
Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust			
5,440 % fällig am 25.07.2036 ^	1.318	1.254	0,49
Structured Asset Securities Corp. Trust			
6,888 % fällig am 25.05.2031	72	57	0,02
Wells Fargo Home Equity Asset-Backed Securities Trust			
6,150 % fällig am 25.10.2034	1.051	1.032	0,41
		17.041	6,69

STAATSEMISSIONEN

BESCHREIBUNG		PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
Chile Government International Bond				
2,750 % fällig am 31.01.2027		300	279	0,11
3,500 % fällig am 31.01.2034		300	265	0,11
Fondo MIVIVIENDA S.A.				
4,625 % fällig am 12.04.2027		300	290	0,11
Mexico Government International Bond				
2,250 % fällig am 12.08.2036	€	870	704	0,28
Romania Government International Bond				
1,750 % fällig am 13.07.2030		600	500	0,20
Serbia Government International Bond				
1,000 % fällig am 23.09.2028		400	339	0,13
South Africa Government International Bond				
10,500 % fällig am 21.12.2026	ZAR	8.000	440	0,17
			2.817	1,11

KURZFRISTIGE INSTRUMENTE

U.S. TREASURY BILLS

5,405 % fällig am 26.09.2023 (b)(c)(h)	$	40.000	39.494	15,50
Summe kurzfristige Instrumente			39.494	15,50
Summe Übertragbare Wertpapiere			**$ 316.722**	**124,35**

PENSIONSGESCHÄFTE

Kontrahent	Kredit-zins	Abrechnungs-datum	Fälligkeits-datum	Kapital-betrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensions-geschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensions-geschäft[1]	% des Nettovermögens
BPS	5,100 %	30.06.2023	03.07.2023	$ 20.900	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.01.2030	$ (21.377)	$ 20.900	$ 20.909	8,21
	5,160	30.06.2023	03.07.2023	3.300	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.07.2031	(3.383)	3.300	3.301	1,30
	5,180	30.06.2023	03.07.2023	7.600	U.S. Treasury Notes 0,375 % fällig am 30.04.2025	(7.755)	7.600	7.603	2,98
Summe Pensionsgeschäfte						**$ (32.515)**	**$ 31.800**	**$ 31.813**	**12,49**

[1] Umfasst aufgelaufene Zinsen.

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

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

FUTURES

Beschreibung	Art	Ablauf-monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
3-Month SOFR December Futures	Short	03.2024	5	$ 33	0,01
3-Month SOFR December Futures	Short	03.2025	3	13	0,01
3-Month SOFR December Futures	Short	03.2026	4	13	0,01
3-Month SOFR June Futures	Short	09.2024	4	23	0,01
3-Month SOFR June Futures	Short	09.2025	2	7	0,00
3-Month SOFR March Futures	Short	06.2024	4	26	0,01
3-Month SOFR March Futures	Short	06.2025	2	8	0,00
3-Month SOFR March Futures	Short	06.2026	3	9	0,00
3-Month SOFR September Futures	Short	12.2024	3	15	0,01
3-Month SOFR September Futures	Short	12.2025	3	10	0,00
Euro-Bund 10-Year Bond September Futures	Long	09.2023	2	(3)	0,00
U.S. Treasury 5-Year Note September Futures	Short	09.2023	10	22	0,01
U.S. Treasury 10-Year Note September Futures	Short	09.2023	52	109	0,04

Beschreibung	Art	Ablauf-monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
U.S. Treasury 10-Year Ultra September Futures	Short	09.2023	10	$ 12	0,01
U.S. Treasury 30-Year Bond September Futures	Long	09.2023	1	0	0,00
U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond September Futures	Short	09.2023	14	(28)	(0,01)
				$ 269	0,11

VERKAUFSOPTIONEN

OPTIONEN AUF BÖRSENGEHANDELTE TERMINKONTRAKTE

Beschreibung	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Anzahl der Kontrakte	Aufgeld	Markt-wert	% des Nettovermögens
Put - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note August Futures	$ 111,500	21.07.2023	5	$ (2)	$ (2)	0,00
Call - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note August Futures	115,500	21.07.2023	5	(2)	0	0,00
Put - CBOT U.S. Treasury 30-Year Bond August Futures	123,000	21.07.2023	1	0	0	0,00
Call - CBOT U.S. Treasury 30-Year Bond August Futures	131,000	21.07.2023	1	(1)	0	0,00
Call - CME-Kaufoptionen mit Ausübungskurs bei 96,000 USD auf 3-Month SOFR September Futures	96,000	15.09.2023	6	(10)	0	0,00
Call - CME-Kaufoptionen mit Ausübungskurs bei 96,063 USD auf 3-Month SOFR December Futures	96,063	15.12.2023	7	(14)	(1)	0,00
Call - CME-Kaufoptionen mit Ausübungskurs bei 96,125 USD auf 3-Month SOFR December Futures	96,125	15.12.2023	6	(11)	(1)	0,00
Call - CME-Kaufoptionen mit Ausübungskurs bei 96,188 USD auf 3-Month SOFR September Futures	96,188	15.09.2023	9	(17)	(1)	0,00
Call - CME-Kaufoptionen mit Ausübungskurs bei 96,375 USD auf 3-Month SOFR December Futures	96,375	15.12.2023	9	(19)	(2)	0,00
Call - CME-Kaufoptionen mit Ausübungskurs bei 98,000 USD auf 3-Month SOFR December Futures	98,000	15.12.2023	3	(2)	0	0,00
Put - CME-Verkaufsoptionen mit Ausübungskurs bei 96,000 USD auf 3-Month SOFR September Futures	96,000	15.09.2023	6	(11)	(21)	(0,01)
Put - CME-Verkaufsoptionen mit Ausübungskurs bei 96,063 USD auf 3-Month SOFR December Futures	96,063	15.12.2023	7	(14)	(26)	(0,01)
Put - CME-Verkaufsoptionen mit Ausübungskurs bei 96,125 USD auf 3-Month SOFR December Futures	96,125	15.12.2023	6	(12)	(23)	(0,01)
Put - CME-Verkaufsoptionen mit Ausübungskurs bei 96,188 USD auf 3-Month SOFR September Futures	96,188	15.09.2023	9	(18)	(36)	(0,01)
Put - CME-Verkaufsoptionen mit Ausübungskurs bei 96,375 USD auf 3-Month SOFR December Futures	96,375	15.12.2023	9	(19)	(40)	(0,02)
Put - CME-Verkaufsoptionen mit Ausübungskurs bei 96,500 USD auf 3-Month SOFR December Futures	96,500	15.12.2023	3	(3)	(14)	(0,01)
				$ (155)	$ (167)	(0,07)
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate					**$ 102**	**0,04**

ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)

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

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMMISSIONEN - SCHUTZVERKAUF[1]

Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag[2]	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
British Telecommunications PLC	1,000 %	20.06.2028	€ 200	$ 0	0,00
British Telecommunications PLC	1,000	20.12.2028	900	2	0,00
Tesco PLC	1,000	20.06.2028	100	0	0,00
				$ 2	0,00

ZINSSWAPS

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Erhalt[3]	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	3,500 %	20.09.2033	£ 1.500	$ 108	0,04
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,000	15.12.2026	¥ 330.000	3	0,00
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,000	16.06.2028	890.000	67	0,03
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,000	15.12.2028	1.690.000	(200)	(0,08)
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,400	15.06.2032	330.000	22	0,01
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,500	15.03.2042	170.000	39	0,02
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	0,000	04.07.2023	$ 500	7	0,00
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	0,000	18.07.2023	500	7	0,00
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	0,000	04.08.2023	8.800	121	0,05
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	0,000	06.09.2023	500	7	0,00
Erhalt[3]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	0,500	16.06.2028	150	16	0,01
Erhalt[3]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	0,750	16.06.2031	100	13	0,01
Zahlung[3]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,250	15.12.2026	6.000	(610)	(0,24)
Erhalt[3]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,250	16.06.2051	40	8	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,270	04.11.2023	8.800	(145)	(0,06)
Erhalt[3]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,350	20.01.2027	200	20	0,01
Erhalt[3]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,360	15.02.2027	550	54	0,02
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,380	04.01.2027	500	(52)	(0,02)
Zahlung[3]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,418	20.01.2027	250	(24)	(0,01)
Erhalt[3]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,420	24.02.2027	400	38	0,01
Zahlung[3]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,425	18.01.2027	500	(47)	(0,02)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,443	18.01.2027	500	(50)	(0,02)
Erhalt[3]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,450	17.02.2027	500	47	0,02
Erhalt[3]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,450	16.07.2031	50	9	0,00
Zahlung[3]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,500	15.12.2028	800	(104)	(0,04)
Erhalt[3]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,500	12.01.2029	110	14	0,01

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Zahlung[3]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,518 %	20.01.2029	$ 150	$ (19)	(0,01)
Zahlung[3]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,535	15.10.2031	200	(32)	(0,01)
Zahlung[3]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,550	20.01.2027	700	(63)	(0,02)
Zahlung[3]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,570	11.01.2027	200	(18)	(0,01)
Zahlung[3]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,570	12.01.2027	100	(9)	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,573	28.02.2027	300	(29)	(0,01)
Zahlung[3]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,580	16.02.2027	300	(26)	(0,01)
Erhalt[3]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,600	16.01.2026	2.700	99	0,04
Zahlung[3]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,600	15.02.2027	2.200	(191)	(0,08)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,618	09.02.2029	200	(24)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,620	18.04.2027	300	(27)	(0,01)
Zahlung[3]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,630	26.01.2029	150	(18)	(0,01)
Zahlung[3]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,650	24.02.2027	1.300	(110)	(0,04)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,650	08.02.2032	250	(38)	(0,02)
Zahlung[3]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,655	24.01.2032	150	(23)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,700	06.03.2024	500	(12)	0,00
Zahlung[3]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,700	17.02.2027	2.100	(174)	(0,07)
Zahlung[3]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,700	12.01.2029	400	(45)	(0,02)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,730	24.02.2032	150	(22)	(0,01)
Zahlung[3]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,735	12.01.2032	150	(23)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,765	16.03.2032	300	(42)	(0,02)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,770	14.02.2032	150	(21)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,783	22.04.2027	400	(34)	(0,01)
Erhalt[3]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,785	12.08.2051	50	16	0,01
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,788	03.05.2027	500	(42)	(0,02)
Zahlung[3]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,815	24.01.2052	50	(15)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,817	05.04.2032	150	(20)	(0,01)
Zahlung[3]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,867	26.01.2052	50	(14)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,872	06.04.2032	150	(20)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,888	22.03.2029	200	(21)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,928	25.03.2027	300	(25)	(0,01)
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,000	21.12.2027	2.820	70	0,03
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,000	21.12.2029	2.600	56	0,02
Zahlung[3]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,000	18.02.2032	200	(25)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,000	21.12.2032	9.850	(316)	(0,12)
Zahlung[3]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,000	15.12.2051	200	(62)	(0,02)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,250	17.06.2027	400	(25)	(0,01)
Erhalt[3]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,300	17.01.2026	2.000	73	0,03
Erhalt[3]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,350	17.01.2025	3.500	82	0,03
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,370	21.06.2027	400	(24)	(0,01)
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,430	30.09.2027	460	36	0,01
Erhalt[3]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,450	20.12.2024	6.800	161	0,06
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,450	04.10.2027	460	35	0,01
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,605	28.06.2027	400	(20)	(0,01)
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,750	21.06.2053	3.200	159	0,06
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,850	30.08.2027	1.000	(52)	(0,02)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,880	30.09.2027	1.300	(64)	(0,03)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,900	04.10.2027	1.300	(63)	(0,02)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,955	04.10.2027	300	(14)	(0,01)
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,000	21.06.2030	1.570	23	0,01
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,000	21.06.2033	40	(2)	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,050	07.09.2027	600	(26)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,050	08.09.2029	600	(26)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,050	06.09.2032	500	(22)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,100	09.09.2029	600	(24)	(0,01)
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,250	21.06.2028	4.810	(142)	(0,06)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,300	06.03.2033	200	(5)	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,340	23.02.2030	400	(10)	0,00
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,350	14.12.2032	100	3	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,370	01.03.2033	200	(3)	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,400	23.02.2033	200	(3)	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,405	01.03.2033	300	(4)	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,420	24.05.2033	300	(3)	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,425	01.03.2033	300	(4)	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,430	27.02.2033	300	(4)	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,450	07.03.2033	500	(5)	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,470	22.02.2030	400	(7)	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,500	22.06.2030	600	(5)	0,00
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,500	22.05.2033	21.620	(62)	(0,02)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,500	21.06.2033	400	0	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,525	02.03.2030	200	(3)	0,00
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,610	12.12.2032	200	2	0,00
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,700	06.06.2033	12.640	(31)	(0,01)
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,750	21.06.2025	10.300	199	0,08
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,750	13.12.2027	400	7	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	4,040	20.06.2024	1.500	(11)	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	4,060	20.06.2024	6.000	(44)	(0,02)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	4,140	22.06.2024	2.500	(16)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	4,500	22.05.2025	47.760	(202)	(0,08)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	4,900	06.06.2025	27.590	(13)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	5,100	22.05.2024	92.690	(101)	(0,04)

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	5,400 %	06.06.2024	$ 53.540	$ 47	0,02
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	0,000	04.07.2023	500	(7)	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	0,000	18.07.2023	500	(7)	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	0,000	04.08.2023	8.800	(121)	(0,05)
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	0,000	06.09.2023	500	(7)	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	0,500	16.09.2023	150	2	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	0,750	16.09.2023	100	1	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,250	15.09.2023	6.000	(66)	(0,03)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,250	16.09.2023	40	0	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,350	20.07.2023	200	1	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,360	15.08.2023	550	4	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,418	20.07.2023	250	(2)	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,420	24.08.2023	400	3	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,425	18.07.2023	500	(3)	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,450	16.07.2023	50	0	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,450	17.08.2023	500	3	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,500	12.07.2023	110	1	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,500	15.09.2023	800	(8)	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,518	20.07.2023	150	(1)	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,535	15.07.2023	200	(2)	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,550	20.07.2023	700	(4)	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,570	11.07.2023	200	(1)	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,570	12.07.2023	100	(1)	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,580	16.08.2023	300	(2)	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,600	15.08.2023	2.200	(12)	(0,01)
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,630	26.07.2023	150	(1)	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,650	24.08.2023	1.300	(7)	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,655	24.07.2023	150	(1)	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,700	12.07.2023	400	(2)	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,700	17.08.2023	2.100	(11)	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,735	12.07.2023	150	(1)	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,785	12.08.2023	50	0	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,815	24.07.2023	50	0	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,867	26.07.2023	50	0	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	2,000	18.08.2023	200	(1)	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	2,000	15.09.2023	200	(2)	0,00
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	1,000	13.05.2027	€ 700	(66)	(0,03)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	1,000	18.05.2027	400	(37)	(0,01)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,100	11.04.2024	400	(6)	0,00
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,100	13.04.2024	800	(13)	(0,01)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,100	17.05.2024	500	(8)	0,00
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,250	28.04.2024	400	(6)	0,00
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,250	03.05.2024	400	(6)	0,00
Erhalt[3]	6-Month EUR-EURIBOR	2,500	20.09.2053	300	(7)	0,00
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,547	09.03.2033	400	(9)	0,00
Erhalt[3]	6-Month EUR-EURIBOR	3,000	20.09.2028	13.500	72	0,03
Erhalt[3]	6-Month EUR-EURIBOR	3,000	20.09.2033	6.300	(56)	(0,02)
					$ (2.561)	(1,00)
Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate					**$ (2.559)**	**(1,00)**

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

(2) Der maximal mögliche Betrag, den der Fonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

(3) Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft.

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

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

OPTIONSKAUF

ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag[1]	Kosten	Markt-wert	% des Nettovermögens
GLM	Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,110 %	26.07.2032	200	$ 32	$ 24	0,01
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,110	26.07.2032	300	49	60	0,02
MYC	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,053	20.07.2023	2.600	16	0	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,053	20.07.2023	2.600	16	57	0,02
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,620	22.07.2024	2.600	19	4	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,620	22.07.2024	2.600	20	40	0,02
	Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,400	20.07.2027	200	26	17	0,01
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,400	20.07.2027	200	26	33	0,01
							$ 204	$ 235	0,09

VERKAUFSOPTIONEN

ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag[1]	Aufgeld	Markt-wert	% des Nettovermögens
BOA	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,150 %	01.12.2023	400	$ (1)	$ 0	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,650	01.12.2023	400	(1)	(6)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,380	31.07.2023	200	(1)	(1)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,780	31.07.2023	200	(1)	(1)	0,00
	Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,070	10.07.2023	200	(1)	(1)	0,00
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,370	10.07.2023	200	(1)	0	0,00
	Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,060	14.07.2023	100	(1)	(1)	0,00
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,360	14.07.2023	100	(1)	0	0,00
BPS	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,200	06.07.2023	100	0	0	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,650	06.07.2023	100	0	0	0,00
	Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,000	03.07.2023	100	(1)	0	0,00
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,400	03.07.2023	100	(1)	0	0,00
BRC	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,260	26.07.2023	100	0	0	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,660	26.07.2023	100	0	(1)	0,00
	Call - OTC 7-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,350	27.07.2023	100	0	0	0,00
	Put - OTC 7-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,850	27.07.2023	100	0	0	0,00
CBK	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,690	02.04.2024	100	(1)	0	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,690	02.04.2024	100	(1)	(2)	0,00
DUB	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,920	13.10.2023	300	(2)	0	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,920	13.10.2023	300	(2)	(7)	(0,01)
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,790	08.04.2024	200	(2)	0	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,790	08.04.2024	200	(2)	(4)	0,00
GLM	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,765	25.07.2023	1.100	(7)	0	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,765	25.07.2023	1.100	(7)	(26)	(0,01)
	Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,468	25.07.2023	200	(5)	0	0,00
	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,468	25.07.2023	200	(5)	(13)	(0,01)
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,920	13.10.2023	200	(1)	0	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,920	13.10.2023	200	(1)	(4)	0,00
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,018	20.10.2023	200	(1)	0	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,018	20.10.2023	200	(1)	(4)	0,00
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,140	23.10.2023	200	(2)	0	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,140	23.10.2023	200	(2)	(4)	0,00
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,190	23.10.2023	200	(1)	0	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,190	23.10.2023	200	(1)	(4)	0,00
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,225	23.10.2023	200	(1)	0	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,225	23.10.2023	200	(1)	(4)	0,00
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,973	25.10.2023	200	(1)	0	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,973	25.10.2023	200	(1)	(4)	0,00
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,841	27.10.2023	200	(1)	0	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,841	27.10.2023	200	(1)	(4)	0,00
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,088	03.11.2023	200	(2)	0	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,088	03.11.2023	200	(2)	(4)	0,00
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,910	10.11.2023	200	(1)	0	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,910	10.11.2023	200	(1)	(4)	0,00
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,250	17.11.2023	400	(2)	0	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,750	17.11.2023	400	(2)	(5)	0,00
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,150	20.11.2023	400	(2)	0	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,650	20.11.2023	400	(2)	(6)	0,00
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,250	07.12.2023	400	(1)	0	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,750	07.12.2023	400	(1)	(5)	0,00
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,697	02.04.2024	500	(4)	(1)	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,697	02.04.2024	500	(4)	(9)	(0,01)
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,721	08.04.2024	200	(2)	0	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,721	08.04.2024	200	(2)	(4)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,260	26.07.2023	200	(1)	0	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,660	26.07.2023	200	(1)	(1)	0,00
	Call - OTC 7-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,350	27.07.2023	100	0	0	0,00
	Put - OTC 7-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,850	27.07.2023	100	0	0	0,00
JPM	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,300	10.07.2023	100	0	0	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,750	10.07.2023	100	0	0	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,250	20.07.2023	300	(1)	0	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,650	20.07.2023	300	(1)	(1)	0,00
MYC	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,052	20.07.2023	1.100	(7)	0	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,052	20.07.2023	1.100	(7)	(24)	(0,01)
	Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,675	20.07.2023	200	(5)	0	0,00
	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,675	20.07.2023	200	(5)	(11)	(0,01)
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,993	11.10.2023	200	(1)	0	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,993	11.10.2023	200	(1)	(4)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,200	06.07.2023	100	0	0	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,650	06.07.2023	100	0	0	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,300	10.07.2023	100	0	0	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,750	10.07.2023	100	0	0	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,270	24.07.2023	200	(1)	0	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,670	24.07.2023	200	(1)	(1)	0,00
	Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,537	20.07.2023	100	(7)	0	0,00
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,537	20.07.2023	100	(7)	(12)	(0,01)
							$ (134)	$ (183)	(0,07)

ZINSCAPS

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Ausübungskurs	Verfallsdatum	Nennbetrag[1]	Aufgeld	Marktwert	% des Nettovermögens
MYC	Call - OTC 1-Year Interest Rate Floor[2]	1-Year USD-LIBOR	0,030 %	24.07.2024	2.600	$ (19)	$ (57)	(0,02)
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Floor[2]	1-Year USD-LIBOR	0,030	24.07.2024	2.600	(19)	(1)	0,00
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Floor[2]	1-Year USD-LIBOR	0,026	23.07.2025	2.600	(23)	(42)	(0,02)
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Floor[2]	1-Year USD-LIBOR	0,026	23.07.2025	2.600	(23)	(6)	0,00
						$ (84)	$ (106)	(0,04)

(1) Der Nennbetrag stellt die Anzahl der Kontrakte dar.

(2) Das zugrunde liegende Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft.

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMMISSIONEN - SCHUTZVERKAUF[1]

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag[2]	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Marktwert	% des Nettovermögens
MYC	South Africa Government International Bond	1,000 %	20.12.2026	$ 1.000	$ (44)	$ 9	$ (35)	(0,02)

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES - SCHUTZVERKAUF[1]

Kontrahent	Index/Tranchen	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag[2]	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Marktwert	% des Nettovermögens
MYC	CMBX.NA.AAA.14 Index	0,500 %	16.12.2072	$ 1.600	$ (39)	$ 6	$ (33)	(0,01)

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

(2) Der maximal mögliche Betrag, den der Fonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung		Zu erhaltende Währung		Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	08.2023	€	184	$	202	$ 1	$ 0	$ 1	0,00
	08.2023	£	566		704	0	(16)	(16)	(0,01)
	08.2023	$	3.667	AUD	5.425	0	(52)	(52)	(0,02)
	08.2023		911	NZD	1.436	0	(31)	(31)	(0,01)
	09.2023		555	KRW	702.848	0	(19)	(19)	(0,01)
BPS	08.2023		215	€	198	2	0	2	0,00
	08.2023		1.685	MXN	29.340	12	0	12	0,00
	08.2023		28	ZAR	519	0	(1)	(1)	0,00
	10.2023		189		3.508	0	(5)	(5)	0,00
BRC	08.2023	£	1.897	$	2.380	0	(31)	(31)	(0,01)
	08.2023	$	246	€	225	0	0	0	0,00
	08.2023		1.339	£	1.052	0	(1)	(1)	0,00
	08.2023		1.377	¥	182.175	0	(108)	(108)	(0,04)
	08.2023		34	ZAR	628	0	(1)	(1)	0,00
CBK	07.2023		934	CLP	756.223	7	0	7	0,00
	07.2023		617	MXN	11.866	74	0	74	0,03
	08.2023	€	168	$	181	0	(3)	(3)	0,00
	08.2023	£	21		26	0	(1)	(1)	0,00
	08.2023	$	596	CAD	795	5	0	5	0,00
	08.2023		262	CLP	214.438	3	0	3	0,00
	08.2023		290	€	266	1	0	1	0,00
	08.2023		360	¥	49.600	0	(14)	(14)	(0,01)
	08.2023		433	NOK	4.521	0	(11)	(11)	0,00
	09.2023	KRW	6.890	$	5	0	0	0	0,00
GLM	08.2023	$	542	NOK	5.747	0	(4)	(4)	0,00
	08.2023		334	ZAR	6.198	0	(7)	(7)	0,00
	10.2023		537		10.073	0	(9)	(9)	0,00
JPM	07.2023		221	MXN	3.894	5	0	5	0,00
	08.2023	£	6.680	$	8.461	0	(34)	(34)	(0,01)
	08.2023	$	977	CAD	1.306	11	0	11	0,00
	08.2023		225	¥	29.939	0	(17)	(17)	(0,01)
	08.2023		200	NOK	2.119	0	(2)	(2)	0,00
	09.2023	IDR	1.304	$	0	0	0	0	0,00
	10.2023	MXN	93		5	0	0	0	0,00
MBC	08.2023	€	21.061		23.240	216	0	216	0,08
	09.2023	$	1.022	KRW	1.302.876	0	(29)	(29)	(0,01)
MYI	07.2023	€	243	$	264	0	0	0	0,00
	07.2023	IDR	11.190		1	0	0	0	0,00
	07.2023	$	53	€	49	0	0	0	0,00
	07.2023		1	£	1	0	0	0	0,00
	07.2023		1	IDR	11.190	0	0	0	0,00
	08.2023	€	295	$	319	0	(3)	(3)	0,00
	08.2023	$	2.946	¥	391.468	0	(221)	(221)	(0,09)

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung		Zu erhaltende Währung		Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
	09.2023	KRW	3.450.069	$	2.642	$ 12	$ 0	$ 12	0,01
	09.2023	$	1	IDR	11.200	0	0	0	0,00
	09.2023		1.144	KRW	1.464.222	0	(28)	(28)	(0,01)
SCX	08.2023	NZD	1.947	$	1.183	0	(9)	(9)	0,00
	08.2023	$	475	AUD	713	0	0	0	0,00
	08.2023		318	NZD	510	0	(6)	(6)	0,00
	09.2023	IDR	1.290.990	$	87	1	0	1	0,00
SSB	07.2023	CLP	757.307		943	0	0	0	0,00
	08.2023	$	943	CLP	759.494	0	0	0	0,00
UAG	08.2023	£	5.851	$	7.396	0	(45)	(45)	(0,02)
						$ 350	$ (708)	$ (358)	(0,14)

ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklassen Institutional AUD (Hedged) ausschüttend und R Class AUD (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung		Zu erhaltende Währung		Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
AZD	07.2023	AUD	5.523	$	3.665	$ 0	$ (11)	$ (11)	(0,01)
	07.2023	$	7.045	AUD	10.764	121	0	121	0,05
	08.2023		3.668		5.523	11	0	11	0,00
BOA	07.2023		21.626		33.284	529	0	529	0,21
BPS	07.2023	AUD	30.669	$	20.313	4	(106)	(102)	(0,04)
	07.2023	$	902	AUD	1.390	24	0	24	0,01
	08.2023		18.996		28.656	94	0	94	0,04
CBK	07.2023		4.489		6.880	91	0	91	0,04
JPM	07.2023		6.834		10.453	124	0	124	0,05
SCX	07.2023	AUD	9.743	$	6.468	0	(18)	(18)	(0,01)
	07.2023	$	5.471	AUD	8.373	102	0	102	0,04
	08.2023		6.473		9.743	18	0	18	0,01
SOG	07.2023		10.804		16.514	188	0	188	0,07
UAG	07.2023	AUD	32.947	$	21.876	42	(97)	(55)	(0,02)
	07.2023	$	8.383	AUD	12.805	141	0	141	0,05
	08.2023		21.893		32.947	97	(42)	55	0,02
						$ 1.586	$ (274)	$ 1.312	0,51

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklassen Institutional CHF (Hedged) thesaurierend und Class E CHF (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung		Zu erhaltende Währung		Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BPS	07.2023	CHF	759	$	849	$ 0	$ 0	$ 0	0,00
	07.2023	$	1.141	CHF	1.033	13	0	13	0,01
	08.2023		849		757	0	0	0	0,00
MYI	07.2023	CHF	37	$	40	0	(1)	(1)	0,00
SCX	07.2023	$	815	CHF	733	4	0	4	0,00
UAG	07.2023	CHF	783	$	873	0	(2)	(2)	0,00
	07.2023	$	735	CHF	660	3	0	3	0,00
	08.2023		873		781	2	0	2	0,00
						$ 22	$ (3)	$ 19	0,01

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklassen Institutional EUR (Hedged) thesaurierend, Institutional EUR (Hedged) ausschüttend, Class E EUR (Hedged) thesaurierend und Class E EUR (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung		Zu erhaltende Währung		Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2023	€	3.145	$	3.437	$ 6	$ 0	$ 6	0,00
	07.2023	$	35.959	€	33.459	544	0	544	0,21
BPS	07.2023	€	32.814	$	35.952	153	0	153	0,06
	07.2023	$	36.016	€	33.502	534	0	534	0,21
	08.2023		35.440		32.300	0	(152)	(152)	(0,06)
CBK	07.2023	€	33.469	$	36.376	0	(138)	(138)	(0,05)
	08.2023	$	35.306	€	32.428	122	0	122	0,05
MBC	07.2023	€	477	$	512	0	(9)	(9)	0,00
	07.2023	$	163	€	151	2	0	2	0,00
SCX	07.2023		1.479		1.382	29	0	29	0,01
SOG	07.2023		35.969		33.437	510	0	510	0,20
						$ 1.900	$ (299)	$ 1.601	0,63

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklasse Institutional GBP (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BPS	07.2023	$ 167	£ 135	$ 4	$ 0	$ 4	0,01
BRC	07.2023	23	19	1	0	1	0,00
CBK	07.2023	7	5	0	0	0	0,00
MBC	07.2023	167	135	4	0	4	0,00
MYI	07.2023	166	134	4	0	4	0,00
RYL	07.2023	£ 27	$ 34	0	0	0	0,00
				$ 13	$ 0	$ 13	0,01

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklasse Institutional NOK (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2023	$ 2.838	NOK 31.475	$ 100	$ (1)	$ 99	0,04
CBK	07.2023	NOK 194	$ 18	0	(1)	(1)	0,00
	07.2023	$ 1.505	NOK 16.919	75	0	75	0,03
GLM	07.2023	NOK 24.766	$ 2.298	0	(14)	(14)	(0,01)
	07.2023	$ 663	NOK 7.114	1	0	1	0,00
	08.2023	2.298	24.742	14	0	14	0,01
RYL	07.2023	2.689	28.856	20	(16)	4	0,00
SCX	07.2023	544	5.938	10	0	10	0,00
				$ 220	$ (32)	$ 188	0,07

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklassen Institutional SEK (Hedged) thesaurierend und Administrative SEK (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2023	SEK 82.108	$ 7.607	$ 7	$ (1)	$ 6	0,00
	07.2023	$ 114	SEK 1.226	0	(1)	(1)	0,00
	08.2023	7.321	78.907	0	(6)	(6)	0,00
CBK	07.2023	5.146	56.206	58	0	58	0,02
GLM	07.2023	SEK 47	$ 4	0	0	0	0,00
	07.2023	$ 7	SEK 78	0	0	0	0,00
MBC	07.2023	SEK 30	$ 3	0	0	0	0,00
	07.2023	$ 4.948	SEK 53.287	0	(15)	(15)	(0,01)
MYI	07.2023	SEK 79.039	$ 7.321	3	0	3	0,00
	07.2023	$ 7.091	SEK 76.120	0	(44)	(44)	(0,01)
	08.2023	7.321	78.941	0	(3)	(3)	0,00
SCX	07.2023	SEK 13	$ 1	0	0	0	0,00
	07.2023	$ 4.943	SEK 53.471	7	0	7	0,00
				$ 75	$ (70)	$ 5	0,00

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklasse Institutional SGD (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BRC	07.2023	$ 93	SGD 126	$ 0	$ 0	$ 0	0,00
GLM	07.2023	SGD 5	$ 4	0	0	0	0,00
MBC	07.2023	$ 85	SGD 115	0	0	0	0,00
MYI	07.2023	SGD 120	$ 89	0	0	0	0,00
	08.2023	$ 89	SGD 120	0	0	0	0,00
SCX	07.2023	14	19	0	0	0	0,00
UAG	07.2023	92	124	0	0	0	0,00
				$ 0	$ 0	$ 0	0,00

Summe Freiverkehrsfinanzderivate	**$ 2.658**	**1,04**

LEERVERKAUFTE WERTPAPIERE

BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
US-REGIERUNGSBEHÖRDEN			
Uniform Mortgage-Backed Security, TBA			
3,000 % fällig am 01.08.2053	$ 500	$ (441)	(0,17)
Summe Leerverkaufte Wertpapiere		**$ (441)**	**(0,17)**
Summe Anlagen		**$ 348.282**	**136,75**
Sonstige Aktiva und Passiva		**$ (93.590)**	**(36,75)**
Nettovermögen		**$ 254.692**	**100,00**

ERLÄUTERUNGEN ZUR AUFSTELLUNG DES WERTPAPIERBESTANDS (Angaben in Tausend*):

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

^ **Das Wertpapier ist in Verzug.**

(a) **Bei dem Wertpapier handelt es sich um ein Interest Only- („IO“) bzw. IO-Strip.**

(b) **Nullkuponwertpapier.**

(c) **Der Kupon stellt eine Rendite bis zur Endfälligkeit dar.**

(d) **Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.**

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

(f) **Bedingt wandelbares Wertpapier.**

(g) **Eingeschränkte Wertpapiere (31. Dezember 2022: 0,38 %):**

Emittentenbeschreibung	Kupon	Fälligkeits-datum	Kauf-datum	Kosten	Markt-wert	% des Nettovermögens
Citigroup, Inc.	5,746 %	25.01.2026	19.07.2022	$ 488	$ 498	0,20
Deutsche Bank AG	3,035	28.05.2032	25.08.2021 - 02.09.2021	359	276	0,11
Standard Chartered PLC	3,603	12.01.2033	05.01.2022	200	160	0,06
				$ 1.047	$ 934	0,37

(h) **Wertpapier mit einem gesamten beizulegenden Zeitwert von 81 USD (31. Dezember 2022: null USD) und Barmittel in Höhe von 183 USD (31. Dezember 2022: 810 USD) wurden zum 30. Juni 2023 gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. als Sicherheit für Finanzderivate verpfändet.**

Barmittel in Höhe von 3.324 USD (31. Dezember 2022: 1.927 USD) wurden zum 30. Juni 2023 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Beizulegender Zeitwert[1]

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 30. Juni 2023 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie[2]	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	$ 0	$ 316.722	$ 0	$ 316.722
Pensionsgeschäfte	0	31.800	0	31.800
Finanzderivate[3]	(3)	204	0	201
Leerverkaufte Wertpapiere	0	(441)	0	(441)
Summen	**$ (3)**	**$ 348.285**	**$ 0**	**$ 348.282**

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

Kategorie[2]	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	$ 0	$ 254.108	$ 0	$ 254.108
Pensionsgeschäfte	0	44.400	0	44.400
Finanzderivate[3]	(9)	1.287	0	1.278
Leerverkaufte Wertpapiere	0	(2.630)	0	(2.630)
Summen	**$ (9)**	**$ 297.165**	**$ 0**	**$ 297.156**

[1] Weitere Informationen finden Sie in den Erläuterungen in Erläuterung 3.

[2] Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung des Wertpapierbestands.

[3] Finanzderivate können offene Terminkontrakte, Swap-, Verkaufs- oder Kaufoptionen sowie Devisenterminkontrakte enthalten.

Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC-Finanzderivate und -Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2023 und 31. Dezember 2022:

	Zum 30. Jun. 2023			Zum 31. Dez. 2022		
Kontrahent	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-engagement[1]	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-engagement[1]
AZD	$ 121	$ (300)	$ (179)	$ 4	$ 0	$ 4
BOA	1.050	(810)	240	43	0	43
BPS	576	(710)	(134)	(571)	550	(21)
BRC	(141)	134	(7)	59	0	59
CBK	266	(280)	(14)	1.021	(950)	71
DUB	(11)	0	(11)	(9)	0	(9)
GLM	(41)	0	(41)	3	260	263
JPM	86	(280)	(194)	187	0	187
MBC	169	(300)	(131)	660	(350)	310
MYC	(75)	0	(75)	(69)	0	(69)
MYI	(281)	130	(151)	263	(20)	243
RYL	4	0	4	88	0	88
SAL	k. A.	k. A.	k. A.	(6)	0	(6)
SCX	138	(290)	(152)	799	(780)	19
SOG	698	(700)	(2)	k. A.	k. A.	k. A.
UAG	99	(270)	(171)	164	0	164

[1] Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären.

Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung des Wertpapierbestands zum 30. Juni 2023:

	30. Jun. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	73,15	36,58
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	51,20	69,50
Sonstige übertragbare Wertpapiere	k. A.	0,71
Pensionsgeschäfte	12,49	18,66
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	0,04	0,05
Zentral abgerechnete Finanzderivate	(1,00)	(0,62)
Freiverkehrsfinanzderivate	1,04	1,11
Leerverkaufte Wertpapiere	(0,17)	(1,11)

Das Anlageportfolio des Fonds konzentriert sich zum 30. Juni 2023 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	30. Jun. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
Kreditbeteiligungen und -abtretung	0,29	0,52
Unternehmensanleihen und Wechsel	37,49	34,38
US-Regierungsbehörden	41,61	29,05
US-Schatzobligationen	7,90	5,52
Non-Agency-MBS	13,76	12,90
Forderungsbesicherte Wertpapiere	6,69	6,03
Staatsemissionen	1,11	1,19
Kurzfristige Instrumente	15,50	17,20
Pensionsgeschäfte	12,49	18,66
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	0,11	0,05
Verkaufsoptionen		
Optionen auf börsengehandelte Terminkontrakte	(0,07)	0,00
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen — Schutzverkauf	0,00	(0,01)
Zinsswaps	(1,00)	(0,61)
Freiverkehrsfinanzderivate		
Optionskauf		
Zinsswapoptionen	0,09	0,08
Verkaufsoptionen		
Zinsswapoptionen	(0,07)	(0,10)
Zinscaps	(0,04)	(0,04)
Optionen auf Wertpapiere	k. A.	0,00
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen — Schutzverkauf	(0,02)	(0,02)
Credit Default Swaps auf Kreditindizes— Schutzverkauf	(0,01)	(0,01)
Devisenterminkontrakte	(0,14)	(0,10)
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	1,23	1,30
Leerverkaufte Wertpapiere	(0,17)	(1,11)
Sonstige Aktiva und Passiva	(36,75)	(24,88)
Nettovermögen	100,00	100,00

BESCHREIBUNG		PAR (000S)		MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE					
KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG					
Hilton Domestic Operating Co., Inc.					
6,939 % fällig am 22.06.2026	$	214	€	197	0,01
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL					
BANKEN UND FINANZEN					
AMCO - Asset Management Co. SpA					
1,500 % fällig am 17.07.2023	€	3.493		3.491	0,20
Banco BPM SpA					
3,750 % fällig am 27.06.2028		5.700		5.679	0,32
Banco Santander S.A.					
4,375 % fällig am 14.01.2026 (e)(g)		4.000		3.362	0,19
Bank of America Corp.					
4,412 % fällig am 24.08.2025		2.950		2.962	0,17
Barclays PLC					
3,125 % fällig am 17.01.2024	£	7.700		8.810	0,50
4,375 % fällig am 15.03.2028 (e)(g)	$	200		125	0,01
6,125 % fällig am 15.12.2025 (e)(g)		800		644	0,04
7,750 % fällig am 15.09.2023 (e)(g)		1.500		1.351	0,08
BNP Paribas S.A.					
4,500 % fällig am 25.02.2030 (e)(g)		200		130	0,01
BPER Banca					
0,625 % fällig am 28.10.2029	€	6.600		5.637	0,32
CaixaBank S.A.					
3,625 % fällig am 14.09.2028 (e)(g)		200		137	0,01
6,750 % fällig am 13.06.2024 (e)(g)		2.000		1.941	0,11
Cooperatieve Rabobank UA					
3,250 % fällig am 29.12.2026 (e)(g)		1.400		1.165	0,07
4,625 % fällig am 29.12.2025 (e)(g)		3.800		3.461	0,20
CPI Property Group S.A.					
1,500 % fällig am 27.01.2031		6.500		3.544	0,20
Credit Mutuel Home Loan SFH S.A.					
3,125 % fällig am 22.06.2027		3.100		3.055	0,17
3,250 % fällig am 20.04.2029		3.800		3.762	0,21
Credit Suisse AG					
4,713 % fällig am 31.05.2024		6.800		6.780	0,39
6,500 % fällig am 08.08.2023 (g)	$	2.600		2.374	0,13
Credit Suisse AG AT1 Claim ^		9.500		349	0,02
Credit Suisse Schweiz AG					
3,390 % fällig am 05.12.2025	€	7.700		7.540	0,43
CTP NV					
0,500 % fällig am 21.06.2025		3.200		2.853	0,16
Deutsche Bank AG					
1,375 % fällig am 03.09.2026		7.400		6.803	0,39
2,222 % fällig am 18.09.2024	$	1.900		1.720	0,10
Dexia Credit Local S.A.					
0,000 % fällig am 21.01.2028 (b)	€	4.300		3.695	0,21
0,010 % fällig am 22.01.2027		6.700		5.928	0,34
DVI Deutsche Vermögens- & Immobilienverwaltungs GmbH					
2,500 % fällig am 25.01.2027		6.500		4.937	0,28
Eurofima Europäische Gesellschaft für die Finanzierung von Eisenbahnmaterial					
0,010 % fällig am 23.06.2028		10.500		8.897	0,51
Europäische Union					
0,000 % fällig am 04.07.2029 (b)		1.000		835	0,05
0,450 % fällig am 04.07.2041		8.600		5.361	0,31
0,450 % fällig am 02.05.2046		930		527	0,03
0,750 % fällig am 04.01.2047		1.600		973	0,05
1,625 % fällig am 04.12.2029		3.000		2.751	0,16
2,625 % fällig am 04.02.2048		4.700		4.248	0,24
Federation des Caisses Desjardins du Quebec					
2,875 % fällig am 28.11.2024		3.400		3.346	0,19
3,250 % fällig am 18.04.2028		3.400		3.342	0,19
Ford Motor Credit Co. LLC					
1,744 % fällig am 19.07.2024		3.500		3.388	0,19
2,748 % fällig am 14.06.2024	£	6.500		7.249	0,41
General Motors Financial Co., Inc.					
1,000 % fällig am 24.02.2025	€	3.400		3.218	0,18
Goldman Sachs Group, Inc.					
4,281 % fällig am 07.02.2025		7.300		7.331	0,42
6,481 % fällig am 15.03.2024	$	1.700		1.565	0,09
Hamburg Commercial Bank AG					
4,875 % fällig am 17.03.2025	€	3.050		3.040	0,17
HSBC Holdings PLC					
6,500 % fällig am 20.05.2024	£	1.800	€	2.097	0,12
ING Groep NV					
3,875 % fällig am 16.05.2027 (e)(g)	$	200		131	0,01
4,875 % fällig am 16.05.2029 (e)(g)		8.200		5.841	0,33
Intesa Sanpaolo SpA					
5,500 % fällig am 01.03.2028 (e)(g)	€	250		210	0,01
Jyske Realkredit A/S					
0,375 % fällig am 01.07.2024		800		772	0,04
1,000 % fällig am 01.10.2050	DKK	15		1	0,00
1,500 % fällig am 01.10.2037		0		0	0,00
1,500 % fällig am 01.07.2050		0		0	0,00
1,500 % fällig am 01.10.2050		22		2	0,00
2,000 % fällig am 01.10.2047		0		0	0,00
2,000 % fällig am 01.10.2050		0		0	0,00
Kreditanstalt fuer Wiederaufbau					
0,000 % fällig am 15.09.2028 (b)	€	6.500		5.558	0,32
0,000 % fällig am 15.09.2031 (b)		15.500		12.222	0,70
2,000 % fällig am 15.11.2029		17.100		16.129	0,92
2,875 % fällig am 29.05.2026		5.200		5.135	0,29
5,000 % fällig am 19.03.2024	AUD	200		122	0,01
Landesbank Baden-Wuerttemberg					
2,000 % fällig am 24.02.2025	$	3.300		2.853	0,16
LeasePlan Corp. NV					
1,375 % fällig am 07.03.2024	€	6.100		5.979	0,34
Liberty Mutual Group, Inc.					
3,625 % fällig am 23.05.2059		9.700		9.238	0,53
Lloyds Bank PLC					
4,875 % fällig am 30.03.2027	£	4.000		4.502	0,26
Lloyds Banking Group PLC					
7,500 % fällig am 27.09.2025 (e)(g)	$	1.700		1.461	0,08
MUFG Bank Ltd.					
3,750 % fällig am 10.03.2024		1.700		1.537	0,09
National Bank of Canada					
3,500 % fällig am 25.04.2028	€	1.800		1.791	0,10
Nordea Kredit Realkreditaktieselskab					
1,000 % fällig am 01.10.2050	DKK	10.642		967	0,05
1,000 % fällig am 01.10.2053		867		77	0,00
1,500 % fällig am 01.10.2050		0		0	0,00
2,000 % fällig am 01.10.2047		0		0	0,00
2,000 % fällig am 01.10.2050		8.275		876	0,05
Nova Kreditna Banka Maribor d.d.					
1,875 % fällig am 27.01.2025	€	5.200		5.030	0,29
Nova Ljubljanska Banka d.d.					
10,750 % fällig am 28.11.2032		5.700		6.101	0,35
Nykredit Realkredit A/S					
0,500 % fällig am 01.10.2043	DKK	8.654		876	0,05
1,000 % fällig am 01.10.2050		11		1	0,00
1,000 % fällig am 01.10.2053		24		2	0,00
1,500 % fällig am 01.10.2037		0		0	0,00
1,500 % fällig am 01.10.2047		4		0	0,00
1,500 % fällig am 01.10.2050		0		0	0,00
1,500 % fällig am 01.10.2053		37.491		3.614	0,21
2,000 % fällig am 01.10.2047		0		0	0,00
2,000 % fällig am 01.10.2050		57.314		6.067	0,35
2,000 % fällig am 01.10.2053		5.646		591	0,03
2,500 % fällig am 01.10.2036		350		44	0,00
2,500 % fällig am 01.10.2047		27		3	0,00
3,000 % fällig am 01.10.2053		4.603		543	0,03
3,500 % fällig am 01.10.2053		24.933		3.059	0,17
5,000 % fällig am 01.10.2053		23.987		3.173	0,18
Realkredit Danmark A/S					
1,500 % fällig am 01.10.2047		65		7	0,00
1,500 % fällig am 01.10.2053		96.027		9.128	0,53
2,000 % fällig am 01.10.2047		0		0	0,00
2,000 % fällig am 01.10.2050		14.886		1.574	0,09
2,500 % fällig am 01.04.2036		1		0	0,00
Royal Bank of Canada					
3,607 % fällig am 17.01.2025	€	5.000		5.011	0,29
4,784 % fällig am 12.12.2025	$	6.500		5.891	0,34
Societe Generale S.A.					
1,250 % fällig am 15.02.2024	€	7.300		7.179	0,41
Societe Generale SFH S.A.					
3,125 % fällig am 24.02.2026		2.100		2.071	0,12
Toronto-Dominion Bank					
1,707 % fällig am 28.07.2025	€	5.100	€	4.877	0,28
3,879 % fällig am 13.03.2026		5.700		5.692	0,32
UBS Group AG					
1,250 % fällig am 17.04.2025		1.600		1.549	0,09
3,250 % fällig am 02.04.2026		6.000		5.785	0,33
4,194 % fällig am 01.04.2031	$	2.500		2.041	0,12
UniCredit SpA					
1,625 % fällig am 03.07.2025	€	7.700		7.478	0,43
3,127 % fällig am 03.06.2032	$	4.400		3.184	0,18
3,375 % fällig am 31.01.2027	€	6.000		5.921	0,34
7,830 % fällig am 04.12.2023	$	3.400		3.135	0,18
Vonovia Finance BV					
5,000 % fällig am 02.10.2023		500		456	0,03
				325.890	18,60
INDUSTRIEWERTE					
BMW Finance NV					
3,609 % fällig am 09.12.2024	€	10.400		10.410	0,59
Fraport AG Frankfurt Airport Services Worldwide					
1,625 % fällig am 09.07.2024		6.000		5.844	0,33
GN Store Nord A/S					
0,875 % fällig am 25.11.2024		3.300		3.079	0,18
Informa PLC					
1,500 % fällig am 05.07.2023		1.476		1.476	0,09
Market Bidco Finco PLC					
4,750 % fällig am 04.11.2027		4.600		3.715	0,21
Molnlycke Holding AB					
1,750 % fällig am 28.02.2024		400		393	0,02
1,875 % fällig am 28.02.2025		400		384	0,02
Mundys SpA					
1,875 % fällig am 12.02.2028		10.150		8.679	0,50
Nissan Motor Co. Ltd.					
1,940 % fällig am 15.09.2023		4.400		4.381	0,25
Teleperformance					
1,875 % fällig am 02.07.2025		200		190	0,01
				38.551	2,20
VERSORGUNGSUNTERNEHMEN					
Electricite de France S.A.					
2,875 % fällig am 15.12.2026 (e)		12.800		10.948	0,62
Summe Unternehmensanleihen und Wechsel				375.389	21,42
US-REGIERUNGSBEHÖRDEN					
Fannie Mae					
5,036 % fällig am 25.07.2037	$	5		4	0,00
5,550 % fällig am 25.06.2036		30		27	0,00
Freddie Mac					
0,000 % fällig am 15.01.2038 (a)		470		18	0,00
3,500 % fällig am 01.10.2047		2.717		2.304	0,13
4,348 % fällig am 15.01.2038		470		419	0,02
4,442 % fällig am 01.09.2037		864		804	0,05
Ginnie Mae					
4,335 % fällig am 20.08.2066		5		4	0,00
Uniform Mortgage-Backed Security					
4,500 % fällig am 01.10.2029 - 01.08.2041		569		515	0,03
Uniform Mortgage-Backed Security, TBA					
4,000 % fällig am 01.08.2053		49.700		42.791	2,44
4,500 % fällig am 01.08.2053		55.200		48.671	2,78
5,000 % fällig am 01.08.2053		55.900		50.220	2,86
				145.777	8,31
US-SCHATZOBLIGATIONEN					
U.S. Treasury Inflation Protected Securities (d)					
0,125 % fällig am 15.07.2024		7.409		6.588	0,38
0,125 % fällig am 15.02.2051		6.524		3.995	0,23
0,500 % fällig am 15.04.2024		7.336		6.562	0,37
0,500 % fällig am 15.01.2028		9.468		8.120	0,46
0,625 % fällig am 15.01.2024		7.280		6.560	0,37
1,000 % fällig am 15.02.2048		3.936		3.107	0,18
1,625 % fällig am 15.10.2027		30.615		27.657	1,58
				62.589	3,57

BESCHREIBUNG		PAR (000S)		MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
NON-AGENCY-MBS					
Adjustable Rate Mortgage Trust					
3,285 % fällig am 25.01.2036 ^	$	5	€	4	0,00
Alba PLC					
5,075 % fällig am 25.11.2042	£	244		277	0,02
5,171 % fällig am 15.12.2038		3.112		3.471	0,20
American Home Mortgage Investment Trust					
6,500 % fällig am 25.03.2047	$	406		277	0,02
Atlas Funding PLC					
5,937 % fällig am 20.01.2061	£	1.683		1.963	0,11
Avon Finance PLC					
5,809 % fällig am 20.09.2048		4.132		4.814	0,27
Banc of America Funding Trust					
5,757 % fällig am 20.05.2047	$	60		49	0,00
Barley Hill PLC					
5,824 % fällig am 27.08.2058	£	1.421		1.646	0,09
Bear Stearns Adjustable Rate Mortgage Trust					
3,993 % fällig am 25.07.2036	$	226		146	0,01
4,635 % fällig am 25.07.2033		3		3	0,00
5,230 % fällig am 25.10.2035		24		21	0,00
Bear Stearns Structured Products, Inc. Trust					
3,484 % fällig am 26.12.2046 ^		63		44	0,00
Canada Square Funding PLC					
5,316 % fällig am 17.01.2059	£	4.582		5.309	0,30
Charter Mortgage Funding PLC					
5,327 % fällig am 16.01.2057		1.559		1.815	0,10
Chase Mortgage Finance Trust					
3,948 % fällig am 25.01.2036	$	2.054		1.657	0,09
6,000 % fällig am 25.05.2037 ^		90		40	0,00
Citigroup Mortgage Loan Trust					
4,321 % fällig am 25.03.2034		1		1	0,00
6,470 % fällig am 25.11.2035		14		12	0,00
Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.					
5,014 % fällig am 25.08.2035 ^		237		202	0,01
Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc. Mortgage Pass-Through Certificates					
3,626 % fällig am 25.09.2035 ^		475		378	0,02
Countrywide Alternative Loan Trust					
3,994 % fällig am 25.06.2037 ^		35		28	0,00
4,048 % fällig am 20.11.2035		267		227	0,01
4,976 % fällig am 25.12.2035		3		3	0,00
5,250 % fällig am 25.06.2035 ^		4		3	0,00
5,500 % fällig am 25.09.2035 ^		1.411		794	0,05
5,570 % fällig am 25.07.2046		118		96	0,01
6,000 % fällig am 25.03.2036 ^		190		80	0,00
6,000 % fällig am 25.08.2037 ^		292		140	0,01
Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust					
3,514 % fällig am 25.04.2035		87		63	0,00
3,573 % fällig am 20.05.2036 ^		46		39	0,00
5,730 % fällig am 25.04.2035		107		91	0,01
5,790 % fällig am 25.03.2035		146		111	0,01
5,890 % fällig am 25.02.2035		145		115	0,01
Deutsche ALT-A Securities Mortgage Loan Trust					
5,530 % fällig am 25.08.2047		3.092		2.321	0,13
Dilosk RMBS DAC					
4,133 % fällig am 20.02.2060	€	3.300		3.299	0,19
4,272 % fällig am 20.12.2060		4.791		4.779	0,27
Dutch Property Finance BV					
3,872 % fällig am 28.04.2051		1.186		1.186	0,07
3,892 % fällig am 28.07.2058		2.394		2.391	0,14
3,942 % fällig am 28.04.2059		3.695		3.677	0,21
3,992 % fällig am 28.10.2059		4.239		4.223	0,24
4,492 % fällig am 28.04.2050		2.442		2.404	0,14
EMF-UK PLC					
5,970 % fällig am 13.03.2046	£	4.186		4.832	0,28
European Loan Conduit DAC					
4,358 % fällig am 17.02.2030	€	5.065		4.959	0,28
Eurosail PLC					
3,619 % fällig am 13.03.2045		655		647	0,04
First Horizon Alternative Mortgage Securities Trust					
4,386 % fällig am 25.03.2035	$	31		18	0,00
Glenbeigh Issuer DAC					
4,350 % fällig am 24.03.2046	€	1.152		1.148	0,07
4,350 % fällig am 24.06.2050		2.788		2.774	0,16
Great Hall Mortgages PLC					
3,677 % fällig am 18.03.2039		140		138	0,01
5,172 % fällig am 18.06.2038	£	34		40	0,00
5,644 % fällig am 18.06.2039	$	38		35	0,00
GSR Mortgage Loan Trust					
3,935 % fällig am 25.01.2036 ^	$	4	€	3	0,00
HarborView Mortgage Loan Trust					
4,424 % fällig am 19.05.2033		3		2	0,00
Harbour					
5,358 % fällig am 28.01.2054	£	4.399		5.106	0,29
Hops Hill PLC					
0,000 % fällig am 21.12.2055		5.200		6.036	0,34
6,204 % fällig am 27.11.2054		3.198		3.751	0,21
IndyMac Mortgage Loan Trust					
3,510 % fällig am 25.11.2035 ^	$	75		60	0,00
5,530 % fällig am 25.09.2046		558		443	0,03
Jubilee Place BV					
4,177 % fällig am 17.10.2057	€	1.773		1.773	0,10
Kentmere PLC					
5,357 % fällig am 28.01.2042	£	1.179		1.370	0,08
Lanebrook Mortgage Transaction PLC					
5,965 % fällig am 12.06.2057		2.420		2.824	0,16
Mansard Mortgages PLC					
5,651 % fällig am 15.12.2049		877		1.001	0,06
MASTR Asset Securitization Trust					
6,000 % fällig am 25.06.2036 ^	$	95		58	0,00
Miravet SARL					
4,265 % fällig am 26.05.2065	€	4.917		4.841	0,28
Newgate Funding PLC					
6,005 % fällig am 15.12.2050	£	230		257	0,01
Oak No. 4 PLC					
0,000 % fällig am 26.02.2065		3.850		4.493	0,26
Paragon Mortgages PLC					
5,752 % fällig am 15.05.2045		610		711	0,04
Pierpont BTL PLC					
0,000 % fällig am 21.09.2054		4.800		5.580	0,32
Polaris PLC					
5,631 % fällig am 23.12.2058		2.870		3.330	0,19
5,640 % fällig am 23.10.2059		5.697		6.593	0,38
6,154 % fällig am 27.05.2057		3.675		4.286	0,24
Precise Mortgage Funding PLC					
6,065 % fällig am 12.12.2055		4.023		4.703	0,27
Primrose Residential DAC					
4,189 % fällig am 24.03.2061	€	8.969		8.907	0,51
4,439 % fällig am 24.10.2061		5.358		5.308	0,30
Residential Accredit Loans, Inc. Trust					
4,165 % fällig am 25.06.2046	$	322		72	0,00
5,470 % fällig am 25.03.2047		1.016		839	0,05
5,510 % fällig am 25.07.2036 ^		1.215		467	0,03
6,000 % fällig am 25.05.2037 ^		46		34	0,00
6,000 % fällig am 25.06.2037 ^		329		235	0,01
Residential Asset Securitization Trust					
5,750 % fällig am 25.02.2036		1.289		911	0,05
Residential Mortgage Securities PLC					
6,159 % fällig am 20.06.2070	£	4.157		4.860	0,28
Resloc UK PLC					
3,686 % fällig am 15.12.2043	€	751		717	0,04
Ripon Mortgages PLC					
5,491 % fällig am 28.08.2056	£	6.578		7.639	0,44
RMAC Securities PLC					
5,134 % fällig am 12.06.2044		58		65	0,00
5,154 % fällig am 12.06.2044		1.029		1.148	0,07
Shamrock Residential DAC					
4,289 % fällig am 24.12.2059	€	1.728		1.711	0,10
Stanlington PLC					
5,815 % fällig am 12.06.2045	£	3.593		4.170	0,24
Stratton Mortgage Funding PLC					
5,391 % fällig am 20.07.2060		13.928		16.232	0,93
5,765 % fällig am 12.03.2052		5.279		6.130	0,35
5,792 % fällig am 25.09.2051		3.283		3.817	0,22
Structured Asset Mortgage Investments Trust					
3,907 % fällig am 25.02.2036 ^	$	182		145	0,01
5,530 % fällig am 25.06.2036		48		42	0,00
5,646 % fällig am 19.07.2035		3		3	0,00
5,846 % fällig am 19.12.2034		57		47	0,00
5,846 % fällig am 19.02.2035		66		56	0,00
Towd Point Mortgage Funding PLC					
5,161 % fällig am 20.10.2051	£	500		577	0,03
5,635 % fällig am 20.10.2051		6.852		7.996	0,46
5,841 % fällig am 20.07.2045		6.552		7.615	0,43
6,097 % fällig am 20.05.2045		7.112		8.264	0,47
6,546 % fällig am 20.02.2054		1.905		2.221	0,13
Tower Bridge Funding PLC					
5,527 % fällig am 20.11.2063	£	4.968	€	5.758	0,33
Trinity Square PLC					
5,316 % fällig am 15.07.2059		6.436		7.489	0,43
Tudor Rose Mortgages					
5,509 % fällig am 20.06.2048		2.614		3.029	0,17
Twin Bridges PLC					
5,525 % fällig am 12.09.2055		3.340		3.848	0,22
5,715 % fällig am 12.03.2055		3.810		4.424	0,25
6,115 % fällig am 12.12.2054		5.572		6.506	0,37
WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust					
3,974 % fällig am 25.05.2037 ^	$	666		541	0,03
Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates Trust					
4,726 % fällig am 25.02.2047 ^		2.558		2.058	0,12
Wells Fargo Alternative Loan Trust					
5,134 % fällig am 25.07.2037 ^		24		19	0,00
				243.911	13,91
FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE					
Accunia European CLO DAC					
4,127 % fällig am 15.07.2030	€	5.180		5.115	0,29
ACE Securities Corp. Home Equity Loan Trust					
5,450 % fällig am 25.07.2036	$	532		181	0,01
Ameriquest Mortgage Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates					
5,855 % fällig am 25.01.2036		228		208	0,01
Aqueduct European CLO DAC					
3,840 % fällig am 20.07.2030	€	4.378		4.321	0,25
Ares European CLO DAC					
3,787 % fällig am 15.04.2030		3.197		3.135	0,18
3,837 % fällig am 15.10.2030		4.670		4.583	0,26
4,325 % fällig am 21.10.2033		4.000		3.934	0,22
Asset-Backed European Securitisation Transaction Twenty-One BV					
4,072 % fällig am 21.09.2031		2.400		2.409	0,14
Asset-Backed Funding Certificates Trust					
6,150 % fällig am 25.06.2037	$	72		51	0,00
Aurium CLO DAC					
3,847 % fällig am 16.04.2030	€	6.047		5.939	0,34
3,907 % fällig am 16.01.2031		4.593		4.505	0,26
Auto ABS French Leases FCT					
4,111 % fällig am 29.06.2033		5.881		5.899	0,34
Autonoria FCT					
3,883 % fällig am 26.01.2043		3.200		3.204	0,18
Bain Capital Euro CLO DAC					
3,940 % fällig am 20.01.2032		4.772		4.667	0,27
Bavarian Sky S.A.					
4,055 % fällig am 20.05.2027		301		302	0,02
Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust					
6,950 % fällig am 25.07.2035	$	591		526	0,03
BlueMountain Fuji EUR CLO DAC					
1,050 % fällig am 15.01.2031	€	99		92	0,01
3,827 % fällig am 15.07.2030		2.221		2.182	0,12
3,897 % fällig am 15.01.2031		4.573		4.481	0,25
4,087 % fällig am 15.01.2033		2.000		1.950	0,11
BNPP AM Euro CLO DAC					
3,827 % fällig am 15.10.2031		1.035		1.011	0,06
Bridgepoint CLO DAC					
4,387 % fällig am 15.01.2034		1.600		1.578	0,09
Bumper UK Finance PLC					
5,287 % fällig am 20.12.2030	£	1.814		2.114	0,12
Cairn CLO DAC					
3,912 % fällig am 31.01.2030	€	4.687		4.615	0,26
3,971 % fällig am 25.04.2032		1.399		1.371	0,08
4,051 % fällig am 25.07.2029		1.014		1.013	0,06
4,212 % fällig am 20.10.2028		24		24	0,00
Carlyle Euro CLO DAC					
3,953 % fällig am 15.08.2030		6.746		6.595	0,38
Carlyle Global Market Strategies Euro CLO DAC					
3,991 % fällig am 25.01.2032		4.993		4.888	0,28
Carlyle Global Market Strategies Euro CLO Ltd.					
4,073 % fällig am 15.11.2031		4.600		4.513	0,26
Citizen Irish Auto Receivables Trust DAC					
4,148 % fällig am 15.12.2029		1.967		1.971	0,11

BESCHREIBUNG		PAR (000S)		MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
Compartment VCL					
4,072 % fällig am 21.01.2028	€	1.883	€	1.888	0,11
Contego CLO BV					
3,947 % fällig am 15.10.2030		3.745		3.687	0,21
Contego CLO DAC					
3,851 % fällig am 23.01.2030		4.588		4.497	0,26
Countrywide Asset-Backed Certificates Trust					
4,473 % fällig am 25.07.2036	$	58		48	0,00
5,290 % fällig am 25.06.2035		4.136		3.303	0,19
5,370 % fällig am 25.06.2047		3.080		2.682	0,15
5,410 % fällig am 25.11.2037		1.934		1.587	0,09
5,990 % fällig am 25.10.2047		1.112		969	0,05
CVC Cordatus Loan Fund DAC					
3,827 % fällig am 15.10.2031	€	3.400		3.336	0,19
4,103 % fällig am 15.08.2032		3.282		3.221	0,18
Ellington Loan Acquisition Trust					
6,200 % fällig am 25.05.2037	$	2.678		2.308	0,13
FCT Pulse France					
4,163 % fällig am 25.01.2035	€	2.900		2.910	0,17
First Franklin Mortgage Loan Trust					
5,310 % fällig am 25.11.2036	$	131		118	0,01
Ginkgo Sales Finance					
4,113 % fällig am 25.11.2049	€	4.842		4.844	0,28
Harvest CLO DAC					
3,817 % fällig am 15.10.2031		5.600		5.467	0,31
3,880 % fällig am 20.10.2031		4.300		4.213	0,24
3,907 % fällig am 15.10.2030		5.676		5.592	0,32
3,937 % fällig am 15.07.2031		5.400		5.270	0,30
4,027 % fällig am 15.01.2032		8.300		8.122	0,46
Invesco Euro CLO DAC					
3,827 % fällig am 15.07.2031		1.550		1.513	0,09
JPMorgan Mortgage Acquisition Trust					
5,420 % fällig am 25.07.2036	$	75		58	0,00
Jubilee CLO DAC					
4,326 % fällig am 15.12.2029	€	2.777		2.746	0,16
Laurelin DAC					
3,920 % fällig am 20.10.2031		6.000		5.892	0,34
Lehman XS Trust					
6,500 % fällig am 25.06.2046	$	2.333		1.805	0,10
Long Beach Mortgage Loan Trust					
5,450 % fällig am 25.05.2036		2.054		1.095	0,06
5,450 % fällig am 25.06.2036		4.742		2.087	0,12
Man GLG Euro CLO DAC					
3,857 % fällig am 15.10.2030	€	2.271		2.230	0,13
3,987 % fällig am 15.10.2032		4.295		4.184	0,24
4,047 % fällig am 15.01.2030		5.012		4.951	0,28
MASTR Asset-Backed Securities Trust					
5,300 % fällig am 25.10.2036	$	3.016		907	0,05
Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust					
5,400 % fällig am 25.07.2036		346		273	0,01
Morgan Stanley Home Equity Loan Trust					
5,290 % fällig am 25.12.2036		2.758		1.228	0,07
Nomura Home Equity Loan, Inc. Home Equity Loan Trust					
5,300 % fällig am 25.07.2036		516		427	0,02
5,765 % fällig am 25.02.2036		1		1	0,00
NovaStar Mortgage Funding Trust					
5,350 % fällig am 25.09.2037		465		413	0,02
5,855 % fällig am 25.01.2036		102		92	0,01
OCP Euro CLO DAC					
3,997 % fällig am 15.01.2032	€	4.096		4.043	0,23
4,091 % fällig am 22.09.2034		5.600		5.454	0,31
Palmer Square European Loan Funding DAC					
3,897 % fällig am 15.10.2031		7.036		6.896	0,39
PBD Germany Auto Lease Master S.A., Compartment					
4,139 % fällig am 26.11.2030		2.412		2.417	0,14
Red & Black Auto Lease France					
4,093 % fällig am 27.06.2035		5.400		5.401	0,31
Revocar UG					
4,032 % fällig am 21.04.2036		4.012		4.024	0,23
SCF Rahoituspalvelut DAC					
4,020 % fällig am 25.06.2033		5.300		5.304	0,30
Sculptor European CLO DAC					
3,916 % fällig am 14.01.2032		4.600		4.519	0,26
Silver Arrow Athlon NL BV					
4,139 % fällig am 26.04.2031		2.895		2.900	0,16
Silver Arrow Merfina SRL					
4,055 % fällig am 20.07.2033		2.956		2.962	0,17
Silver Arrow S.A.					
3,768 % fällig am 15.02.2030	€	2.389	€	2.391	0,14
4,028 % fällig am 15.02.2027		224		224	0,01
SLC Student Loan Trust					
6,271 % fällig am 25.11.2042	$	560		509	0,03
SLM Student Loan Trust					
3,661 % fällig am 25.10.2039	€	426		398	0,02
Soundview Home Loan Trust					
5,650 % fällig am 25.10.2036	$	4.886		4.181	0,24
Tikehau CLO DAC					
4,144 % fällig am 04.08.2034	€	4.000		3.909	0,22
Toro European CLO DAC					
3,995 % fällig am 12.01.2032		3.900		3.825	0,22
Turbo Finance PLC					
5,617 % fällig am 20.08.2028	£	844		984	0,06
Voya Euro CLO DAC					
3,927 % fällig am 15.10.2030	€	3.067		3.028	0,17
				244.710	13,95
STAATSEMISSIONEN					
Agence Francaise de Developpement					
0,125 % fällig am 29.09.2031		2.200		1.706	0,10
Autonomous Community of Catalonia					
4,220 % fällig am 26.04.2035		1.600		1.589	0,09
Belgium Government International Bond					
1,400 % fällig am 22.06.2053		20.000		12.770	0,73
1,600 % fällig am 22.06.2047		14.000		10.029	0,57
Caisse Francaise de Financement Local					
3,482 % fällig am 25.02.2025		9.600		9.555	0,55
Cassa Depositi e Prestiti SpA					
5,750 % fällig am 05.05.2026	$	6.000		5.432	0,31
Europäische Finanzstabilisierungsfazilität					
0,000 % fällig am 13.10.2027 (b)	€	400		349	0,02
Europäischer Stabilitätsmechanismus					
3,000 % fällig am 23.08.2033		2.800		2.793	0,16
Europäische Union					
0,800 % fällig am 04.07.2025		700		664	0,04
2,750 % fällig am 05.10.2026		6.000		5.907	0,34
3,375 % fällig am 04.10.2038		14.820		15.010	0,86
France Government International Bond					
0,100 % fällig am 25.07.2031 (d)		3.509		3.411	0,19
0,100 % fällig am 25.07.2038 (d)		689		642	0,04
0,500 % fällig am 25.05.2072		4.700		1.852	0,11
0,550 % fällig am 01.03.2039 (d)		8.737		8.718	0,50
0,750 % fällig am 25.05.2052		2.900		1.581	0,09
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro					
0,400 % fällig am 15.05.2030 (d)		4.269		3.905	0,22
1,300 % fällig am 15.05.2028 (d)		14.439		14.166	0,81
2,800 % fällig am 01.03.2067		16.300		11.676	0,67
3,850 % fällig am 01.09.2049		7.500		7.004	0,40
4,500 % fällig am 01.10.2053		14.300		14.559	0,83
Korea Housing Finance Corp.					
0,723 % fällig am 22.03.2025		4.500		4.238	0,24
Mexico Government International Bond					
2,659 % fällig am 24.05.2031	$	9.700		7.413	0,42
Bundesrepublik Deutschland					
0,000 % fällig am 15.08.2050 (b)(h)	€	4.200		2.273	0,13
Romania Government International Bond					
2,000 % fällig am 28.01.2032		7.700		5.665	0,32
Slovenia Government International Bond					
0,000 % fällig am 12.02.2031 (b)		6.100		4.782	0,27
1,000 % fällig am 06.03.2028		3.600		3.240	0,19
1,175 % fällig am 13.02.2062		8.410		4.753	0,27
3,125 % fällig am 07.08.2045		7.000		6.514	0,37
3,625 % fällig am 11.03.2033		1.300		1.345	0,08
5,250 % fällig am 18.02.2024	$	21.451		19.656	1,12
South Korea Government International Bond					
0,000 % fällig am 16.09.2025 (b)	€	4.400		4.053	0,23
Spain Government International Bond					
0,000 % fällig am 31.01.2026 (b)		72.400		66.494	3,79
0,000 % fällig am 31.01.2028 (b)		7.100		6.134	0,35
0,100 % fällig am 30.04.2031		300		235	0,01
0,850 % fällig am 30.07.2037		1.100		769	0,04
1,400 % fällig am 30.07.2028		13.200		12.091	0,69
1,450 % fällig am 31.10.2027		23.300		21.625	1,23
1,900 % fällig am 31.10.2052		21.200		14.048	0,80
2,800 % fällig am 31.05.2026		4.500		4.427	0,25
3,150 % fällig am 30.04.2033		1.200			
	€	54	€	1.230	0,07
3,450 % fällig am 30.07.2043		9.100		8.650	0,49
3,450 % fällig am 30.07.2066		9.400		8.572	0,49
3,550 % fällig am 31.10.2033		870		878	0,05
3,900 % fällig am 30.07.2039		1.600		1.636	0,09
Svensk Exportkredit AB					
3,250 % fällig am 13.04.2026		5.300		5.245	0,30
				349.284	19,92
		AKTIEN			
VORZUGSWERTPAPIERE					
Nationwide Building Society					
10,250 %		903		121	0,01
		PAR (000S)			
KURZFRISTIGE INSTRUMENTE					
COMMERCIAL PAPER					
SGS Nederland Holding BV					
3,660 % fällig am 10.07.2023	€	5.900		5.894	0,34
Universal Music Group NV					
3,691 % fällig am 24.07.2023		2.000		1.996	0,11
				7.890	0,45
JAPAN TREASURY BILLS					
(0,206) % fällig am 18.07.2023 (b)(c)	¥	5.337.000		33.847	1,93
(0,202) % fällig am 28.08.2023 (b)(c)		5.982.000		37.943	2,16
(0,200) % fällig am 28.08.2023 (b)(c)		1.258.000		7.979	0,46
(0,199) % fällig am 11.09.2023 (b)(c)		4.545.000		28.830	1,64
(0,197) % fällig am 31.07.2023 (b)(c)		1.652.000		10.477	0,60
(0,188) % fällig am 18.07.2023 (b)(c)		943.000		5.981	0,34
(0,179) % fällig am 11.09.2023 (b)(c)		1.015.000		6.438	0,37
(0,178) % fällig am 31.07.2023 (b)(c)		469.000		2.975	0,17
(0,175) % fällig am 07.08.2023 (b)(c)		5.700.000		36.152	2,06
				170.622	9,73
Summe kurzfristige Instrumente				178.512	10,18
Summe Übertragbare Wertpapiere				**€ 1.600.490**	**91,28**
		AKTIEN			
INVESTMENTFONDS					
BÖRSENGEHANDELTE FONDS					
PIMCO ETFs plc - PIMCO Euro Short Maturity UCITS ETF (f)		1.371.800		132.603	7,56
Summe Investmentfonds				**€ 132.603**	**7,56**

PENSIONSGESCHÄFTE

Kontrahent	Kredit-zins	Abrechnungs-datum	Fälligkeits-datum	Kapital-betrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensions-geschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensions-geschäft[1]	% des Nettovermögens
COM	3,250 %	30.06.2023	03.07.2023	€ 101.800	State of North Rhine-Westphalia 2,350 % fällig am 13.12.2029	€ (100.000)	€ 101.800	€ 101.828	5,80
					State of Saarland 0,010 % fällig am 11.05.2027	(8.561)			
FICC	2,400	30.06.2023	03.07.2023	$ 2.666	U.S. Treasury Notes 4,625 % fällig am 30.06.2025	(2.493)	2.444	2.444	0,14
Summe Pensionsgeschäfte						**€ (111.054)**	**€ 104.244**	**€ 104.272**	**5,94**

[1] Umfasst aufgelaufene Zinsen.

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

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

FUTURES

Beschreibung	Art	Ablauf-monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Euro-Bobl September Futures	Long	09.2023	2.917	€ (4.344)	(0,25)
Euro-BTP Italy Government Bond September Futures	Long	09.2023	791	612	0,04
Euro-Bund 10-Year Bond September Futures	Short	09.2023	2.615	2.697	0,15
Euro-Buxl 30-Year Bond September Futures	Long	09.2023	546	984	0,06
Euro-OAT France Government 10-Year Bond September Futures	Long	09.2023	1.485	(145)	(0,01)
Euro-Schatz September Futures	Long	09.2023	1.472	(975)	(0,06)
Japan Government 10-Year Bond September Futures	Short	09.2023	24	(78)	0,00
U.S. Treasury 2-Year Note September Futures	Short	09.2023	444	374	0,02
U.S. Treasury 5-Year Note September Futures	Short	09.2023	1.727	2.784	0,16
U.S. Treasury 10-Year Note September Futures	Long	09.2023	1.115	(2.036)	(0,12)
U.S. Treasury 10-Year Ultra September Futures	Short	09.2023	764	718	0,04
U.S. Treasury 30-Year Bond September Futures	Long	09.2023	117	29	0,00
U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond September Futures	Short	09.2023	433	(775)	(0,04)
				€ (155)	(0,01)

VERKAUFSOPTIONEN

OPTIONEN AUF BÖRSENGEHANDELTE TERMINKONTRAKTE

Beschreibung	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Anzahl der Kontrakte	Aufgeld	Markt-wert	% des Nettovermögens
Put - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note August Futures	$ 113,000	21.07.2023	320	€ (210)	€ (327)	(0,02)
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate					**€ (482)**	**(0,03)**

ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)

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

ZINSSWAPS

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,000 %	16.06.2029	¥ 7.571.000	€ (557)	(0,03)
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,435	20.06.2029	2.729.000	(123)	(0,01)
Zahlung[1]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,880	25.01.2052	$ 11.900	(3.063)	(0,17)
Erhalt[1]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,865	13.02.2054	29.200	577	0,03
Zahlung[1]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,085	13.02.2034	65.700	(1.075)	(0,06)
Erhalt[1]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	4,250	20.12.2025	127.600	703	0,04
Zahlung	3-Month EUR-EURIBOR	0,526	21.11.2023	€ 124.100	(2.894)	(0,17)
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,880	25.07.2023	$ 11.900	(43)	0,00
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	0,550	10.08.2024	€ 5.200	(212)	(0,01)
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	1,700	15.03.2073	4.900	561	0,03
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,250	21.09.2037	46.800	(1.127)	(0,06)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,250	21.09.2042	21.400	(783)	(0,05)
Erhalt[1]	6-Month EUR-EURIBOR	2,500	20.09.2053	80.600	(887)	(0,05)
Zahlung[1]	6-Month EUR-EURIBOR	3,000	20.09.2028	196.600	292	0,02
Zahlung[1]	6-Month EUR-EURIBOR	3,000	20.09.2033	462.100	3.190	0,18
Erhalt[1]	6-Month EUR-EURIBOR	3,500	20.09.2025	104.900	(73)	0,00
Zahlung	CPTFEMU	1,380	15.03.2031	28.500	(5.877)	(0,34)
Erhalt	CPTFEMU	2,359	15.08.2030	2.800	98	0,01
Zahlung	CPTFEMU	2,421	15.05.2052	990	(149)	(0,01)
Erhalt	CPTFEMU	2,470	15.07.2032	2.300	102	0,01

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Zahlung	CPTFEMU	2,488 %	15.05.2037	€ 6.880	€ (481)	(0,03)
Erhalt	CPTFEMU	2,600	15.05.2032	4.500	193	0,01
Erhalt	CPTFEMU	2,720	15.06.2032	6.600	156	0,01
Erhalt	CPTFEMU	2,975	15.08.2027	6.700	58	0,00
Erhalt	CPTFEMU	3,340	15.08.2027	25.900	(144)	(0,01)
Erhalt	CPURNSA	3,479	18.07.2023	$ 26.800	189	0,01
					€ (11.369)	(0,65)
Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate					**€ (11.369)**	**(0,65)**

(1) Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft.

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

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

VERKAUFSOPTIONEN

ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag(1)	Aufgeld	Markt-wert	% des Nettovermögens
BOA	Call - OTC 2-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	4,420 %	21.09.2023	123.100	€ (646)	€ (483)	(0,03)
BPS	Call - OTC 2-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,750	12.09.2023	123.100	(327)	(130)	(0,01)
							€ (973)	€ (613)	(0,04)

(1) Der Nennbetrag stellt die Anzahl der Kontrakte dar.

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

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag(2)	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Markt-wert	% des Nettovermögens
GST	South Africa Government International Bond	1,000 %	20.12.2023	$ 200	€ (8)	€ 8	€ 0	0,00
	South Africa Government International Bond	1,000	20.06.2024	16.800	(655)	657	2	0,00
					€ (663)	€ 665	€ 2	0,00

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

(2) Der maximal mögliche Betrag, den der Fonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2023	DKK 60.704	€ 8.152	€ 0	€ 0	€ 0	0,00
	07.2023	€ 6.636	$ 7.138	0	(93)	(93)	(0,01)
	08.2023	AUD 220	€ 135	1	0	1	0,00
	09.2023	KRW 34.796	$ 27	1	0	1	0,00
BPS	07.2023	€ 4.908	DKK 36.575	4	0	4	0,00
	07.2023	197.949	$ 216.893	853	0	853	0,05
	08.2023	CNH 19.021	2.770	134	0	134	0,01
	08.2023	€ 2.587	£ 2.212	0	(14)	(14)	0,00
	08.2023	£ 4.009	€ 4.660	0	(2)	(2)	0,00
	08.2023	$ 1.187	CNH 8.204	0	(51)	(51)	0,00
	08.2023	217.198	€ 197.949	0	(860)	(860)	(0,05)
	09.2023	IDR 921.895	$ 61	0	0	0	0,00
BRC	07.2023	€ 25.363	DKK 188.854	1	0	1	0,00
	08.2023	DKK 188.803	€ 25.363	0	(2)	(2)	0,00
	08.2023	€ 1.341	¥ 196.700	0	(88)	(88)	(0,01)
CBK	07.2023	$ 3.724	€ 3.452	39	0	39	0,00
	09.2023	€ 95.160	¥ 14.878.000	0	(107)	(107)	(0,01)
JPM	07.2023	DKK 203.313	€ 27.300	0	(5)	(5)	0,00
	07.2023	€ 5.182	DKK 38.590	1	0	1	0,00
	08.2023	DKK 38.580	€ 5.182	0	(1)	(1)	0,00
	08.2023	£ 71.890	82.559	0	(1.052)	(1.052)	(0,06)
	08.2023	¥ 5.700.000	38.193	1.913	0	1.913	0,11
	08.2023	$ 953	CNH 6.586	0	(41)	(41)	0,00
	09.2023	IDR 1.887.579	$ 127	1	0	1	0,00
	10.2023	MXN 322	18	0	0	0	0,00

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung		Zu erhaltende Währung		Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
MBC	07.2023	¥	6.280.000	€	44.360	€ 4.477	€ 0	€ 4.477	0,25
	07.2023	$	2.152		2.012	40	0	40	0,00
	08.2023	€	15.127	¥	2.203.529	0	(1.091)	(1.091)	(0,06)
	08.2023	¥	7.240.000	€	48.744	2.566	0	2.566	0,15
	09.2023		5.750.000		37.112	327	0	327	0,02
	09.2023	KRW	64.503	$	51	1	0	1	0,00
MYI	07.2023	€	1.472		1.590	0	(15)	(15)	0,00
	07.2023	IDR	16.379		1	0	0	0	0,00
	07.2023	$	5.303	€	4.962	101	0	101	0,01
	07.2023		1	IDR	16.379	0	0	0	0,00
	08.2023	€	3.504	£	3.003	0	(11)	(11)	0,00
	08.2023	£	9.427	€	10.894	0	(70)	(70)	(0,01)
	09.2023	IDR	507.220	$	34	0	0	0	0,00
	09.2023	KRW	72.491		57	1	0	1	0,00
	09.2023	$	1	IDR	16.394	0	0	0	0,00
RBC	08.2023	€	2.073	¥	306.600	0	(120)	(120)	(0,01)
	08.2023	$	543	MXN	9.405	1	0	1	0,00
RYL	08.2023	£	3.591	€	4.122	0	(54)	(54)	0,00
	09.2023	¥	9.128.000		61.631	3.363	0	3.363	0,20
SCX	08.2023	€	1.198	£	1.031	2	0	2	0,00
	08.2023	£	92.347	€	105.756	0	(1.649)	(1.649)	(0,09)
	08.2023	$	454	CNH	3.121	0	(21)	(21)	0,00
	09.2023	IDR	1.566.231	$	105	0	0	0	0,00
SOG	07.2023	$	210.448	€	195.631	2.736	0	2.736	0,16
UAG	07.2023	¥	2.121.000		14.576	1.086	0	1.086	0,06
	09.2023		5.560.000		37.393	1.878	0	1.878	0,11
						€ 19.527	€ (5.347)	€ 14.180	0,82

ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklasse Institutional CHF (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung		Zu erhaltende Währung		Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2023	€	106.043	CHF	102.615	€ 0	€ (906)	€ (906)	(0,05)
BRC	07.2023		48.625		47.213	0	(251)	(251)	(0,01)
MYI	07.2023	CHF	2.464	€	2.543	19	0	19	0,00
	07.2023	€	63.959	CHF	62.089	0	(344)	(344)	(0,02)
RBC	07.2023	CHF	2.317	€	2.358	0	(16)	(16)	0,00
UAG	07.2023		99.885		102.053	0	(287)	(287)	(0,02)
	07.2023	€	105.868	CHF	102.385	0	(967)	(967)	(0,06)
	08.2023		102.053		99.741	300	0	300	0,02
						€ 319	€ (2.771)	€ (2.452)	(0,14)

Summe Freiverkehrsfinanzderivate	**€ 11.117**	**0,64**
Summe Anlagen	**€ 1.836.603**	**104,74**
Sonstige Aktiva und Passiva	**€ (83.042)**	**(4,74)**
Nettovermögen	**€ 1.753.561**	**100,00**

ERLÄUTERUNGEN ZUR AUFSTELLUNG DES WERTPAPIERBESTANDS (Angaben in Tausend*):

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

^ **Das Wertpapier ist in Verzug.**

(a) **Bei dem Wertpapier handelt es sich um ein Interest Only- („IO“) bzw. IO-Strip.**

(b) **Nullkuponwertpapier.**

(c) **Der Kupon stellt eine Rendite bis zur Endfälligkeit dar.**

(d) **Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.**

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

(f) **Mit dem Fonds verbunden.**

(g) **Bedingt wandelbares Wertpapier.**

(h) **Wertpapier mit einem gesamten beizulegenden Zeitwert von 2.273 EUR (31. Dezember 2022: 4.360 EUR) und Barmittel in Höhe von 1.500 EUR (31. Dezember 2022: 5.628 EUR) wurden zum 30. Juni 2023 gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. als Sicherheit für Finanzderivate verpfändet.**

Barmittel in Höhe von 48.591 EUR (31. Dezember 2022: 53.376 EUR) wurden zum 30. Juni 2023 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Beizulegender Zeitwert[1]

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 30. Juni 2023 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie[2]	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	€ 0	€ 1.600.242	€ 248	€ 1.600.490
Investmentfonds	15.515	117.088	0	132.603
Pensionsgeschäfte	0	104.244	0	104.244
Finanzderivate[3]	(1.249)	515	0	(734)
Summen	**€ 14.266**	**€ 1.822.089**	**€ 248**	**€ 1.836.603**

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

Kategorie[2]	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	€ 0	€ 1.747.790	€ 0	€ 1.747.790
Investmentfonds	180.784	870	0	181.654
Pensionsgeschäfte	0	11.515	0	11.515
Finanzderivate[3]	(33.951)	(39.063)	0	(73.014)
Summen	**€ 146.833**	**€ 1.721.112**	**€ 0**	**€ 1.867.945**

(1) Weitere Informationen finden Sie in den Erläuterungen in Erläuterung 3.

(2) Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung des Wertpapierbestands.

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

Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC-Finanzderivate und -Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2023 und 31. Dezember 2022:

	Zum 30. Jun. 2023			Zum 31. Dez. 2022		
Kontrahent	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-engagement[1]	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-engagement[1]
BOA	€ (1.480)	€ 1.790	€ 310	€ (136)	€ 0	€ (136)
BPS	(66)	0	(66)	(3.776)	1.243	(2.533)
BRC	(340)	580	240	(672)	250	(422)
CBK	(68)	0	(68)	(250)	0	(250)
GLM	k. A.	k. A.	k. A.	(662)	553	(109)
GST	2	11	13	(1.966)	1.883	(83)
JPM	816	(1.331)	(515)	(3.086)	3.064	(22)
MBC	6.320	(6.180)	140	(236)	(390)	(626)
MYC	k. A.	k. A.	k. A.	(26)	70	44
MYI	(319)	424	105	(46)	37	(9)
RBC	(135)	0	(135)	(30)	0	(30)
RYL	3.309	(3.300)	9	(198)	30	(168)
SCX	(1.668)	968	(700)	(313)	373	60
SOG	2.736	(3.010)	(274)	k. A.	k. A.	k. A.
SSB	k. A.	k. A.	k. A.	2.746	(1.770)	976
UAG	2.010	(1.450)	560	(962)	(4.040)	(5.002)

(1) Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären.

Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung des Wertpapierbestands zum 30. Juni 2023:

	30. Jun. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	70,93	71,54
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	20,33	19,58
Sonstige übertragbare Wertpapiere	0,02	0,23
Investmentfonds	7,56	9,49
Pensionsgeschäfte	5,94	0,60
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	(0,03)	(1,69)
Zentral abgerechnete Finanzderivate	(0,65)	(1,62)
Freiverkehrsfinanzderivate	0,64	(0,50)

Das Anlageportfolio des Fonds konzentriert sich zum 30. Juni 2023 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	30. Jun. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
Kreditbeteiligungen und -abtretung	0,01	0,01
Unternehmensanleihen und Wechsel	21,42	26,04
US-Regierungsbehörden	8,31	5,29
US-Schatzobligationen	3,57	2,26
Non-Agency-MBS	13,91	12,23
Forderungsbesicherte Wertpapiere	13,95	12,40
Staatsemissionen	19,92	20,18
Vorzugswertpapiere	0,01	0,07
Kurzfristige Instrumente	10,18	12,87
Investmentfonds	7,56	9,49
Pensionsgeschäfte	5,94	0,60
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	(0,01)	(1,69)
Verkaufsoptionen		
Optionen auf börsengehandelte Terminkontrakte	(0,02)	k. A.
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen		
— Schutzverkauf	k. A.	0,00
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzkauf	k. A.	(0,13)
Zinsswaps	(0,65)	(1,49)
Freiverkehrsfinanzderivate		
Optionskauf		
Zinsswapoptionen	k. A.	0,51
Verkaufsoptionen		
Zinsswapoptionen	(0,04)	(1,04)
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen		
— Schutzverkauf	0,00	0,00
Devisenterminkontrakte	0,82	0,07
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	(0,14)	(0,04)
Sonstige Aktiva und Passiva	(4,74)	2,37
Nettovermögen	100,00	100,00

BESCHREIBUNG		PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
BANKEN UND FINANZEN				
ABN AMRO Bank NV				
2,375 % fällig am 01.06.2027	€	4.600	€ 4.295	0,70
2,470 % fällig am 13.12.2029	$	2.300	1.767	0,29
AerCap Ireland Capital DAC				
2,875 % fällig am 14.08.2024		1.300	1.146	0,19
American Tower Corp.				
0,875 % fällig am 21.05.2029	€	400	326	0,05
4,625 % fällig am 16.05.2031		3.500	3.525	0,58
Aroundtown S.A.				
0,000 % fällig am 16.07.2026 (b)		1.300	997	0,16
0,375 % fällig am 15.04.2027		900	648	0,11
1,450 % fällig am 09.07.2028		100	68	0,01
Atrium Finance PLC				
2,625 % fällig am 05.09.2027		1.560	1.137	0,19
Avolon Holdings Funding Ltd.				
2,528 % fällig am 18.11.2027	$	172	133	0,02
3,950 % fällig am 01.07.2024		100	89	0,01
Balder Finland Oyj				
1,000 % fällig am 18.01.2027	€	1.200	905	0,15
Banca Monte dei Paschi di Siena SpA				
2,625 % fällig am 28.04.2025		1.900	1.784	0,29
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A.				
6,138 % fällig am 14.09.2028	$	4.200	3.862	0,63
Banco Santander S.A.				
2,375 % fällig am 08.09.2027	€	1.600	1.523	0,25
Bank of America Corp.				
4,134 % fällig am 12.06.2028		3.100	3.072	0,50
Banque Federative du Credit Mutuel S.A.				
0,625 % fällig am 19.11.2027		10.100	8.592	1,41
Barclays PLC				
0,577 % fällig am 09.08.2029		1.900	1.523	0,25
BNP Paribas S.A.				
1,904 % fällig am 30.09.2028	$	9.000	7.035	1,15
4,400 % fällig am 14.08.2028		1.185	1.026	0,17
BPCE S.A.				
0,500 % fällig am 15.09.2027	€	8.400	7.360	1,21
BPCE SFH S.A.				
3,375 % fällig am 27.06.2033		1.100	1.105	0,18
CaixaBank S.A.				
5,375 % fällig am 14.11.2030		700	721	0,12
Caja Rural de Navarra SCC				
3,000 % fällig am 26.04.2027		1.600	1.558	0,26
CBRE Global Investors Open-Ended Fund S.C.A. SICAV-SIF Pan European Core Fund				
0,500 % fällig am 27.01.2028		500	395	0,07
0,900 % fällig am 12.10.2029		2.300	1.684	0,28
Cooperatieve Rabobank UA				
4,655 % fällig am 22.08.2028	$	7.100	6.234	1,02
CPI Property Group S.A.				
1,500 % fällig am 27.01.2031	€	4.900	2.672	0,44
Credit Agricole Home Loan SFH S.A.				
3,250 % fällig am 08.06.2033		1.900	1.887	0,31
Credit Agricole S.A.				
1,907 % fällig am 16.06.2026	$	2.600	2.195	0,36
Cromwell Ereit Lux Finco SARL				
2,125 % fällig am 19.11.2025	€	1.600	1.381	0,23
CTP NV				
0,625 % fällig am 27.09.2026		600	485	0,08
0,875 % fällig am 20.01.2026		3.100	2.647	0,43
Deutsche Bank AG				
1,625 % fällig am 20.01.2027		3.900	3.468	0,57
2,129 % fällig am 24.11.2026 (e)	$	400	326	0,05
3,125 % fällig am 19.05.2033	€	1.600	1.592	0,26
Digital Euro Finco LLC				
2,625 % fällig am 15.04.2024		2.100	2.055	0,34
EQT AB				
2,375 % fällig am 06.04.2028		2.100	1.853	0,30
Equitable Financial Life Global Funding				
0,600 % fällig am 16.06.2028		2.900	2.441	0,40
Europäische Finanzstabilisierungsfazilität				
1,250 % fällig am 24.05.2033		7.000	5.927	0,97
2,375 % fällig am 11.04.2028		6.300	6.078	1,00
Europäische Investitionsbank				
0,050 % fällig am 13.10.2034	€	12.700	€ 9.076	1,49
0,250 % fällig am 20.01.2032		7.500	5.949	0,98
2,250 % fällig am 15.03.2030		12.800	12.190	2,00
Europäischer Stabilitätsmechanismus				
0,750 % fällig am 15.03.2027		6.700	6.125	1,00
Europäische Union				
0,000 % fällig am 04.11.2025 (b)		6.700	6.205	1,02
0,000 % fällig am 04.10.2030 (b)		15.400	12.428	2,03
0,000 % fällig am 04.07.2031 (b)		1.900	1.499	0,25
0,000 % fällig am 04.07.2035 (b)		4.300	2.971	0,49
0,400 % fällig am 04.02.2037		8.900	6.233	1,02
0,450 % fällig am 04.07.2041		9.700	6.046	0,99
2,750 % fällig am 04.02.2033		7.600	7.435	1,22
2,750 % fällig am 04.12.2037		6.200	5.905	0,97
Fairfax Financial Holdings Ltd.				
2,750 % fällig am 29.03.2028		3.600	3.243	0,53
GA Global Funding Trust				
1,625 % fällig am 15.01.2026	$	200	163	0,03
Globalworth Real Estate Investments Ltd.				
3,000 % fällig am 29.03.2025	€	497	411	0,07
Goldman Sachs Group, Inc.				
0,875 % fällig am 09.05.2029		4.000	3.295	0,54
4,000 % fällig am 21.09.2029		1.500	1.481	0,24
Hamburg Commercial Bank AG				
6,250 % fällig am 18.11.2024		5.300	5.320	0,87
ING Groep NV				
4,500 % fällig am 23.05.2029		3.100	3.069	0,50
Intesa Sanpaolo SpA				
3,625 % fällig am 30.06.2028		900	894	0,15
4,000 % fällig am 23.09.2029	$	3.700	2.949	0,48
JAB Holdings BV				
4,750 % fällig am 29.06.2032	€	3.100	3.133	0,51
JPMorgan Chase & Co.				
1,963 % fällig am 23.03.2030		3.500	3.093	0,51
Jyske Realkredit A/S				
0,500 % fällig am 01.10.2043	DKK	0	0	0,00
1,000 % fällig am 01.10.2050		0	0	0,00
1,000 % fällig am 01.10.2053		0	0	0,00
1,500 % fällig am 01.10.2037		255	30	0,01
1,500 % fällig am 01.10.2050		0	0	0,00
LeasePlan Corp. NV				
0,250 % fällig am 07.09.2026	€	2.600	2.289	0,38
Liberty Mutual Finance Europe DAC				
1,750 % fällig am 27.03.2024		400	392	0,06
Lloyds Bank PLC				
3,250 % fällig am 02.02.2026		700	689	0,11
Lloyds Banking Group PLC				
3,750 % fällig am 18.03.2028	$	1.900	1.610	0,26
Logicor Financing SARL				
3,250 % fällig am 13.11.2028	€	2.000	1.712	0,28
Metropolitan Life Global Funding				
4,000 % fällig am 05.04.2028		2.200	2.194	0,36
Mizuho Financial Group, Inc.				
2,096 % fällig am 08.04.2032		1.800	1.525	0,25
Morgan Stanley				
5,123 % fällig am 01.02.2029	$	3.600	3.256	0,53
Nationale-Nederlanden Bank NV				
3,250 % fällig am 28.05.2027	€	1.400	1.388	0,23
Nationwide Building Society				
4,363 % fällig am 01.08.2024	$	3.400	3.110	0,51
NatWest Group PLC				
1,750 % fällig am 02.03.2026	€	1.839	1.747	0,29
NE Property BV				
1,875 % fällig am 09.10.2026		200	174	0,03
3,375 % fällig am 14.07.2027 (f)		2.200	1.977	0,32
NN Group NV				
6,000 % fällig am 03.11.2043		1.950	1.953	0,32
Nordea Bank Abp				
4,125 % fällig am 05.05.2028		2.200	2.181	0,36
Nordea Kredit Realkreditaktieselskab				
0,500 % fällig am 01.10.2043	DKK	0	0	0,00
1,000 % fällig am 01.10.2050		0	0	0,00
1,000 % fällig am 01.10.2053		0	0	0,00
1,500 % fällig am 01.10.2037		144	17	0,00
1,500 % fällig am 01.10.2050		0	0	0,00
2,500 % fällig am 01.10.2047		0	0	0,00
Nykredit Realkredit A/S				
0,250 % fällig am 13.01.2026	€	3.200	€ 2.876	0,47
0,375 % fällig am 17.01.2028		1.200	991	0,16
0,500 % fällig am 01.10.2043	DKK	0	0	0,00
1,000 % fällig am 01.10.2050		0	0	0,00
1,000 % fällig am 01.10.2053		0	0	0,00
1,500 % fällig am 01.10.2037		280	33	0,01
1,500 % fällig am 01.10.2050		0	0	0,00
2,000 % fällig am 01.10.2053		0	0	0,00
2,500 % fällig am 01.10.2036		34	4	0,00
2,500 % fällig am 01.10.2047		0	0	0,00
P3 Group SARL				
1,625 % fällig am 26.01.2029	€	2.400	1.900	0,31
Pacific Life Global Funding				
1,200 % fällig am 24.06.2025	$	200	167	0,03
Prologis International Funding S.A.				
3,125 % fällig am 01.06.2031	€	900	798	0,13
Realkredit Danmark A/S				
2,500 % fällig am 01.04.2036	DKK	3	0	0,00
2,500 % fällig am 01.04.2047		0	0	0,00
Sagax AB				
1,125 % fällig am 30.01.2027	€	1.600	1.350	0,22
Sagax Euro MTN NL BV				
0,750 % fällig am 26.01.2028		800	607	0,10
Santander UK Group Holdings PLC				
0,603 % fällig am 13.09.2029		5.200	4.152	0,68
SELP Finance SARL				
3,750 % fällig am 10.08.2027		400	375	0,06
Sirius Real Estate Ltd.				
1,125 % fällig am 22.06.2026		2.500	2.067	0,34
Societe Generale S.A.				
1,792 % fällig am 09.06.2027	$	2.400	1.925	0,32
Sofina S.A.				
1,000 % fällig am 23.09.2028	€	2.500	2.002	0,33
Sumitomo Mitsui Banking Corp.				
3,602 % fällig am 16.02.2026		700	691	0,11
Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc.				
1,474 % fällig am 08.07.2025	$	400	337	0,06
Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd.				
3,629 % fällig am 06.04.2026	€	1.200	1.185	0,19
Toronto-Dominion Bank				
3,879 % fällig am 13.03.2026		3.000	2.996	0,49
TP ICAP Finance PLC				
2,625 % fällig am 18.11.2028	£	1.600	1.378	0,23
UBS Group AG				
0,625 % fällig am 18.01.2033	€	3.700	2.570	0,42
1,250 % fällig am 17.04.2025		4.100	3.970	0,65
3,869 % fällig am 12.01.2029	$	2.100	1.742	0,29
4,194 % fällig am 01.04.2031		400	327	0,05
4,282 % fällig am 09.01.2028		2.400	2.035	0,33
WEA Finance LLC				
3,750 % fällig am 17.09.2024		1.700	1.472	0,24
Wells Fargo & Co.				
1,000 % fällig am 02.02.2027	€	4.500	3.985	0,65
WPC Eurobond BV				
1,350 % fällig am 15.04.2028		2.100	1.786	0,29
			276.595	45,34
INDUSTRIEWERTE				
Abertis Infraestructuras S.A.				
1,625 % fällig am 15.07.2029		100	87	0,01
4,125 % fällig am 07.08.2029		1.700	1.668	0,27
Amgen, Inc.				
5,250 % fällig am 02.03.2033	$	1.500	1.377	0,23
Arcadis NV				
4,875 % fällig am 28.02.2028	€	1.500	1.500	0,25
Becton Dickinson Euro Finance SARL				
3,553 % fällig am 13.09.2029		1.900	1.864	0,31
Boston Scientific Corp.				
0,625 % fällig am 01.12.2027		2.900	2.537	0,42
Cellnex Finance Co. S.A.				
1,000 % fällig am 15.09.2027		1.800	1.550	0,25
Chanel Ceres PLC				
0,500 % fällig am 31.07.2026		4.100	3.655	0,60
DAE Funding LLC				
1,550 % fällig am 01.08.2024	$	1.400	1.219	0,20
3,375 % fällig am 20.03.2028		900	744	0,12

BESCHREIBUNG		PAR (000S)		MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
Danone S.A.					
3,470 % fällig am 22.05.2031	€	2.900	€	2.887	0,47
Deutsche Bahn Finance GmbH					
3,250 % fällig am 19.05.2033		500		493	0,08
Fraport AG Frankfurt Airport Services Worldwide					
1,875 % fällig am 31.03.2028		800		708	0,12
2,125 % fällig am 09.07.2027		2.900		2.664	0,44
General Mills, Inc.					
3,907 % fällig am 13.04.2029		400		401	0,07
Global Payments, Inc.					
4,875 % fällig am 17.03.2031		1.100		1.096	0,18
GN Store Nord A/S					
0,875 % fällig am 25.11.2024		4.600		4.291	0,70
H Lundbeck A/S					
0,875 % fällig am 14.10.2027		2.100		1.824	0,30
Heineken NV					
4,125 % fällig am 23.03.2035		900		930	0,15
Holding d'Infrastructures de Transport SASU					
1,625 % fällig am 18.09.2029		100		86	0,01
4,250 % fällig am 18.03.2030		2.300		2.278	0,37
IMCD NV					
2,125 % fällig am 31.03.2027		100		90	0,01
InterContinental Hotels Group PLC					
3,375 % fällig am 08.10.2028	£	2.400		2.375	0,39
International Flavors & Fragrances, Inc.					
1,800 % fällig am 25.09.2026	€	850		765	0,13
JDE Peet's NV					
0,500 % fällig am 16.01.2029		3.850		3.171	0,52
John Lewis PLC					
4,250 % fällig am 18.12.2034	£	1.050		763	0,12
Medtronic Global Holdings S.C.A.					
2,250 % fällig am 07.03.2039	€	2.000		1.592	0,26
Mitchells & Butlers Finance PLC					
5,965 % fällig am 15.12.2025	£	5		5	0,00
6,002 % fällig am 15.12.2030	$	388		328	0,05
6,013 % fällig am 15.12.2030	£	105		110	0,02
Mondelez International Holdings Netherlands BV					
0,625 % fällig am 09.09.2032	€	2.100		1.604	0,26
Motability Operations Group PLC					
3,500 % fällig am 17.07.2031		2.000		1.960	0,32
Mundys SpA					
1,875 % fällig am 12.02.2028		2.800		2.394	0,39
Netflix, Inc.					
3,875 % fällig am 15.11.2029		3.300		3.222	0,53
Nokia Oyj					
4,375 % fällig am 21.08.2031		1.600		1.578	0,26
Robert Bosch GmbH					
4,375 % fällig am 02.06.2043		1.400		1.437	0,24
Sage Group PLC					
3,820 % fällig am 15.02.2028		900		889	0,15
SEB S.A.					
1,500 % fällig am 31.05.2024		3.100		3.030	0,50
Siemens Energy Finance BV					
4,250 % fällig am 05.04.2029		1.100		1.071	0,18
Siemens Financieringsmaatschappij NV					
3,625 % fällig am 24.02.2043		2.600		2.559	0,42
Sika Capital BV					
3,750 % fällig am 03.05.2030		1.000		997	0,16
Silfin NV					
2,875 % fällig am 11.04.2027		900		810	0,13
Societa per Azioni Esercizi Aeroportuali SEA SpA					
3,500 % fällig am 09.10.2025		2.100		1.998	0,33
Suez SACA					
2,375 % fällig am 24.05.2030		1.700		1.532	0,25
4,625 % fällig am 03.11.2028		1.500		1.535	0,25
5,000 % fällig am 03.11.2032		1.700		1.807	0,30
Sydney Airport Finance Co. Pty. Ltd.					
4,375 % fällig am 03.05.2033		600		598	0,10
Syngenta Finance NV					
4,892 % fällig am 24.04.2025	$	3.751		3.367	0,55
T-Mobile USA, Inc.					
4,800 % fällig am 15.07.2028		3.500		3.143	0,52
5,050 % fällig am 15.07.2033		600		540	0,09
5,750 % fällig am 15.01.2054		500		474	0,08
Teleperformance					
3,750 % fällig am 24.06.2029	€	1.300		1.250	0,20
TenneT Holding BV					
4,750 % fällig am 28.10.2042	€	1.100	€	1.227	0,20
Thames Water Utilities Finance PLC					
0,875 % fällig am 31.01.2028		1.800		1.436	0,24
4,375 % fällig am 18.01.2031		2.200		1.963	0,32
Ubisoft Entertainment S.A.					
0,878 % fällig am 24.11.2027		1.700		1.307	0,21
Universal Music Group NV					
3,750 % fällig am 30.06.2032		1.600		1.569	0,26
4,000 % fällig am 13.06.2031		1.600		1.596	0,26
Vilmorin & Cie S.A.					
1,375 % fällig am 26.03.2028		2.200		1.728	0,28
Werfen S.A.					
4,625 % fällig am 06.06.2028		4.600		4.543	0,74
Worley U.S. Finance Sub Ltd.					
0,875 % fällig am 09.06.2026		2.500		2.235	0,37
				98.457	16,14
VERSORGUNGSUNTERNEHMEN					
AT&T, Inc.					
3,950 % fällig am 30.04.2031		1.200		1.191	0,20
Cadent Finance PLC					
4,250 % fällig am 05.07.2029 (a)		800		796	0,13
E.ON SE					
3,875 % fällig am 12.01.2035		1.800		1.790	0,29
Electricite de France S.A.					
4,250 % fällig am 25.01.2032		2.700		2.674	0,44
EnBW International Finance BV					
4,000 % fällig am 24.01.2035		1.900		1.860	0,30
EP Infrastructure A/S					
1,816 % fällig am 02.03.2031		2.400		1.687	0,28
Fluvius System Operator CVBA					
3,875 % fällig am 09.05.2033		2.700		2.695	0,44
National Grid Electricity Distribution East Midlands PLC					
3,530 % fällig am 20.09.2028		300		292	0,05
National Grid PLC					
3,875 % fällig am 16.01.2029		2.700		2.679	0,44
RTE Reseau de Transport d'Electricite SADIR					
3,750 % fällig am 04.07.2035 (a)		1.400		1.396	0,23
TDC Net A/S					
5,056 % fällig am 31.05.2028		1.700		1.671	0,27
5,618 % fällig am 06.02.2030		1.800		1.768	0,29
Verizon Communications, Inc.					
4,750 % fällig am 31.10.2034		3.600		3.777	0,62
				24.276	3,98
Summe Unternehmensanleihen und Wechsel				399.328	65,46
US-REGIERUNGSBEHÖRDEN					
Ginnie Mae, TBA					
4,500 % fällig am 01.08.2053	$	4.000		3.541	0,58
Uniform Mortgage-Backed Security, TBA					
3,000 % fällig am 01.08.2053		1.300		1.050	0,17
5,000 % fällig am 01.09.2053		8.200		7.370	1,21
				11.961	1,96
NON-AGENCY-MBS					
Canada Square Funding PLC					
5,852 % fällig am 17.06.2058	£	944		1.094	0,18
Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust					
4,249 % fällig am 25.08.2034 ^	$	21		17	0,00
Domi BV					
4,156 % fällig am 15.06.2053	€	945		941	0,15
Dutch Property Finance BV					
3,892 % fällig am 28.07.2058		2.104		2.101	0,34
3,992 % fällig am 28.10.2059		3.410		3.397	0,56
Great Hall Mortgages PLC					
5,644 % fällig am 18.06.2039	$	169		153	0,02
Jubilee Place BV					
4,027 % fällig am 17.01.2059	€	2.172		2.167	0,36
4,177 % fällig am 17.10.2057		443		443	0,07
Landmark Mortgage Securities PLC					
4,865 % fällig am 17.04.2044	£	804		907	0,15
Miravet SARL					
4,265 % fällig am 26.05.2065	€	1.870		1.841	0,30
Newgate Funding PLC					
4,126 % fällig am 15.12.2050	€	173	€	167	0,03
Primrose Residential DAC					
4,439 % fällig am 24.10.2061		2.420		2.397	0,39
RMAC Securities PLC					
5,134 % fällig am 12.06.2044	£	85		95	0,02
Structured Asset Mortgage Investments Trust					
5,846 % fällig am 19.12.2034	$	58		47	0,01
Towd Point Mortgage Funding PLC					
5,635 % fällig am 20.10.2051	£	1.182		1.380	0,23
Twin Bridges PLC					
5,715 % fällig am 12.03.2055		1.966		2.283	0,37
				19.430	3,18
FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE					
Ares European CLO DAC					
3,787 % fällig am 15.04.2030	€	492		482	0,08
Aurium CLO DAC					
4,618 % fällig am 23.03.2032		1.300		1.280	0,21
Bastille Euro CLO DAC					
4,327 % fällig am 15.01.2034		2.700		2.630	0,43
BlueMountain Fuji EUR CLO DAC					
3,827 % fällig am 15.07.2030		327		321	0,05
Bosphorus CLO DAC					
4,496 % fällig am 12.12.2032		1.900		1.858	0,31
Cairn CLO DAC					
3,971 % fällig am 25.04.2032		600		588	0,10
4,051 % fällig am 25.07.2029		500		499	0,08
Carlyle Euro CLO DAC					
3,953 % fällig am 15.08.2030		634		620	0,10
Carlyle Global Market Strategies Euro CLO DAC					
4,137 % fällig am 16.01.2033		1.600		1.551	0,25
Contego CLO BV					
3,947 % fällig am 15.10.2030		699		688	0,11
CVC Cordatus Loan Fund DAC					
4,103 % fällig am 15.08.2032		995		976	0,16
4,447 % fällig am 17.06.2032		900		880	0,14
Dryden Euro CLO DAC					
4,027 % fällig am 15.07.2031		695		686	0,11
4,183 % fällig am 15.05.2034		200		196	0,03
GoldenTree Loan Management EUR CLO DAC					
4,100 % fällig am 20.01.2032		100		98	0,02
Harvest CLO DAC					
4,027 % fällig am 15.01.2032		200		196	0,03
Invesco Euro CLO DAC					
3,827 % fällig am 15.07.2031		500		488	0,08
Jubilee CLO DAC					
3,777 % fällig am 15.04.2030		1.000		977	0,16
4,326 % fällig am 15.12.2029		633		626	0,10
Madison Park Euro Funding DAC					
3,977 % fällig am 15.07.2032		600		585	0,10
Man GLG Euro CLO DAC					
3,987 % fällig am 15.10.2032		2.797		2.724	0,45
OCP Euro CLO DAC					
3,997 % fällig am 15.01.2032		365		360	0,06
Palmer Square European Loan Funding DAC					
3,897 % fällig am 15.10.2031		2.580		2.529	0,42
4,227 % fällig am 15.10.2031		847		834	0,14
Renaissance Home Equity Loan Trust					
5,340 % fällig am 25.01.2037	$	1.291		416	0,07
Segovia European CLO DAC					
4,080 % fällig am 20.07.2032	€	500		487	0,08
Toro European CLO DAC					
3,995 % fällig am 12.01.2032		200		196	0,03
4,133 % fällig am 15.02.2034		500		487	0,08
Voya Euro CLO DAC					
3,927 % fällig am 15.10.2030		192		189	0,03
				24.447	4,01
STAATSEMISSIONEN					
Adif Alta Velocidad					
3,500 % fällig am 30.07.2028 (a)		3.000		2.984	0,49
BNG Bank NV					
3,000 % fällig am 11.01.2033		6.000		5.942	0,97

BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
Caisse Francaise de Financement Local			
3,125 % fällig am 16.11.2027	€ 200	€ 197	0,03
CPPIB Capital, Inc.			
0,050 % fällig am 24.02.2031	3.800	2.959	0,49
Europäische Finanzstabilisierungsfazilität			
3,000 % fällig am 15.12.2028	11.000	10.923	1,79
Europäische Union			
1,500 % fällig am 04.10.2035	7.400	6.202	1,02
Korea Housing Finance Corp.			
3,714 % fällig am 11.04.2027	3.100	3.071	0,50
Mexico Government International Bond			
6,350 % fällig am 09.02.2035	$ 2.200	2.125	0,35
Poland Government International Bond			
3,875 % fällig am 14.02.2033	€ 2.800	2.781	0,46
Province of Ontario			
0,010 % fällig am 25.11.2030	3.800	2.978	0,49
Province of Quebec			
3,000 % fällig am 24.01.2033	4.200	4.068	0,67
Region of Ile de France			
3,050 % fällig am 03.02.2033	7.200	7.079	1,16
3,700 % fällig am 14.06.2038	500	509	0,08

BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
Romania Government International Bond			
6,625 % fällig am 27.09.2029	€ 3.400	€ 3.539	0,58
		55.357	9,08
KURZFRISTIGE INSTRUMENTE			
SCHATZTITEL DES EUROPÄISCHEN STABILITÄTSMECHANISMUS			
3,337 % fällig am 07.09.2023 (b)(c)	300	298	0,05
SCHATZTITEL DER EUROPÄISCHEN UNION			
3,168 % fällig am 04.08.2023 (b)(c)	350	349	0,06
3,172 % fällig am 04.08.2023 (b)(c)	150	150	0,03
3,173 % fällig am 04.08.2023 (b)(c)	700	698	0,11
3,174 % fällig am 04.08.2023 (b)(c)	250	249	0,04
3,179 % fällig am 04.08.2023 (b)(c)	250	249	0,04
3,326 % fällig am 08.09.2023 (b)(c)	200	199	0,03
		1.894	0,31

BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
FRANCE TREASURY BILLS			
2,672 % fällig am 05.07.2023 (b)(c)	200	200	0,03
3,057 % fällig am 19.07.2023 (b)(c)	9.000	8.989	1,48
3,116 % fällig am 19.07.2023 (b)(c)	800	799	0,13
		9.988	1,64
GERMANY TREASURY BILLS			
3,143 % fällig am 19.07.2023 (b)(c)	€ 6.000	€ 5.992	0,98
Summe kurzfristige Instrumente		18.172	2,98
Summe Übertragbare Wertpapiere		**€ 528.695**	**86,67**
	AKTIEN		
INVESTMENTFONDS			
BÖRSENGEHANDELTE FONDS			
PIMCO ETFs plc - PIMCO Euro Short Maturity UCITS ETF (d)	532.500	51.452	8,44
Summe Investmentfonds		**€ 51.452**	**8,44**

PENSIONSGESCHÄFTE

Kontrahent	Kredit-zins	Abrechnungs-datum	Fälligkeits-datum	Kapital-betrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensions-geschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensions-geschäft[1]	% des Nettovermögens
COM	3,250 %	30.06.2023	03.07.2023	€ 27.600	State of North Rhine-Westphalia 3,400 % fällig am 07.03.2073	€ (28.356)	€ 27.600	€ 27.607	4,53
FICC	2,400	30.06.2023	03.07.2023	1.066	U.S. Treasury Notes 4,625 % fällig am 30.06.2025	(997)	977	977	0,16
Summe Pensionsgeschäfte						**€ (29.353)**	**€ 28.577**	**€ 28.584**	**4,69**

[1] Umfasst aufgelaufene Zinsen.

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

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

FUTURES

Beschreibung	Art	Ablauf-monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Euro-Bobl September Futures	Long	09.2023	271	€ (411)	(0,07)
Euro-BTP Italy Government Bond September Futures	Long	09.2023	68	(12)	0,00
Euro-Bund 10-Year Bond September Futures	Short	09.2023	177	(8)	0,00
Euro-Buxl 30-Year Bond September Futures	Long	09.2023	134	273	0,05
Euro-Schatz September Futures	Long	09.2023	963	(852)	(0,14)
U.S. Treasury 5-Year Note September Futures	Short	09.2023	164	312	0,05
U.S. Treasury 10-Year Note September Futures	Short	09.2023	150	147	0,02
U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond September Futures	Long	09.2023	27	59	0,01
				€ (492)	(0,08)
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate				**€ (492)**	**(0,08)**

ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)

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

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMMISSIONEN - SCHUTZVERKAUF[1]

Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag[2]	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
AT&T, Inc.	1,000 %	20.06.2026	$ 5.000	€ (44)	(0,01)
AT&T, Inc.	1,000	20.06.2028	1.300	9	0,00
British Telecommunications PLC	1,000	20.12.2027	€ 1.100	(7)	0,00
British Telecommunications PLC	1,000	20.06.2028	3.300	(11)	0,00
British Telecommunications PLC	1,000	20.12.2028	1.600	6	0,00
Electricite de France S.A.	1,000	20.12.2026	1.300	(12)	0,00
Telefonica Emisiones S.A.	1,000	20.06.2028	100	0	0,00
				€ (59)	(0,01)

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES - SCHUTZVERKAUF[1]

Index/Tranchen	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag[2]	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
iTraxx Europe Main 39 5-Year Index	1,000 %	20.06.2028	€ 32.200	€ 195	0,03
iTraxx Europe Main 39 10-Year Index	1,000	20.06.2033	200	1	0,00
				€ 196	0,03

ZINSSWAPS

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Erhalt[3]	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	3,750 %	20.09.2028	£ 5.900	€ 344	0,06
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,050	15.12.2031	¥ 1.860.000	(29)	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	0,000	16.09.2023	$ 42.700	(558)	(0,09)
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	0,500	16.06.2026	27.600	2.452	0,40
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	0,750	16.06.2031	15.100	2.014	0,33
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,750	15.06.2024	23.000	(200)	(0,03)
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,750	15.06.2052	3.400	265	0,04
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	0,000	16.09.2023	42.700	562	0,09
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	0,500	09.02.2024	€ 52.200	(1.040)	(0,17)
Erhalt[3]	6-Month EUR-EURIBOR	2,500	20.09.2053	8.100	(44)	(0,01)
Zahlung[3]	6-Month EUR-EURIBOR	3,000	20.09.2028	35.700	(99)	(0,02)
Zahlung[3]	6-Month EUR-EURIBOR	3,000	20.09.2033	30.200	219	0,04
					€ 3.886	0,64
Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate					**€ 4.023**	**0,66**

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

(2) Der maximal mögliche Betrag, den der Fonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

(3) Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft.

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

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

DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2023	€ 869	$ 952	€ 4	€ 0	€ 4	0,00
BPS	07.2023	65.701	71.983	279	0	279	0,04
	08.2023	CNH 404	59	3	0	3	0,00
	08.2023	$ 68.407	€ 62.345	0	(271)	(271)	(0,04)
BRC	08.2023	£ 120	139	0	(1)	(1)	0,00
CBK	08.2023	CNH 53	$ 8	0	0	0	0,00
JPM	08.2023	£ 4.138	€ 4.750	0	(63)	(63)	(0,01)
MBC	08.2023	¥ 45.461	312	22	0	22	0,00
MYI	07.2023	$ 3.269	3.047	51	(1)	50	0,01
	08.2023	€ 1.790	£ 1.534	0	(6)	(6)	0,00
RBC	08.2023	$ 58	MXN 1.002	0	0	0	0,00
SCX	08.2023	£ 6.562	€ 7.514	0	(117)	(117)	(0,02)
SOG	07.2023	$ 68.334	63.523	889	0	889	0,15
				€ 1.248	€ (459)	€ 789	0,13
Summe Freiverkehrsfinanzderivate						**€ 789**	**0,13**
Summe Anlagen						**€ 613.044**	**100,51**
Sonstige Aktiva und Passiva						**€ (3.105)**	**(0,51)**
Nettovermögen						**€ 609.939**	**100,00**

ERLÄUTERUNGEN ZUR AUFSTELLUNG DES WERTPAPIERBESTANDS (Angaben in Tausend*):

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

^ **Das Wertpapier ist in Verzug.**

(a) **Wertpapier per Emissionstermin.**

(b) **Nullkuponwertpapier.**

(c) Der Kupon stellt eine Rendite bis zur Endfälligkeit dar.

(d) Mit dem Fonds verbunden.

(e) Eingeschränkte Wertpapiere (31. Dezember 2022: 0,08 %):

Emittentenbeschreibung	Kupon	Fälligkeits-datum	Kauf-datum	Kosten	Markt-wert	% des Nettovermögens
Deutsche Bank AG	2,129 %	24.11.2026	17.11.2020	€ 337	€ 326	0,05

(f) Wertpapier mit einem gesamten beizulegenden Zeitwert von 539 EUR (31. Dezember 2022: 262 EUR) und Barmittel in Höhe von null EUR (31. Dezember 2022: 1.150 EUR) wurden zum 30. Juni 2023 gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte als Sicherheit verpfändet.

Barmittel in Höhe von 10.762 EUR (31. Dezember 2022: 25.216 EUR) wurden zum 30. Juni 2023 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Beizulegender Zeitwert[1]

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 30. Juni 2023 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie[2]	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	€ 0	€ 528.648	€ 47	€ 528.695
Investmentfonds	0	51.452	0	51.452
Pensionsgeschäfte	0	28.577	0	28.577
Finanzderivate[3]	(1.010)	5.330	0	4.320
Summen	**€ (1.010)**	**€ 614.007**	**€ 47**	**€ 613.044**

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

Kategorie[2]	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	€ 0	€ 491.678	€ 0	€ 491.678
Investmentfonds	50.689	0	0	50.689
Pensionsgeschäfte	0	44.621	0	44.621
Finanzderivate[3]	(2.892)	(1.106)	0	(3.998)
Summen	**€ 47.797**	**€ 535.193**	**€ 0**	**€ 582.990**

[1] Weitere Informationen finden Sie in den Erläuterungen in Erläuterung 3.

[2] Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung des Wertpapierbestands.

[3] Finanzderivate können offene Terminkontrakte, Swap-, Verkaufs- oder Kaufoptionen sowie Devisenterminkontrakte enthalten.

Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2023:

Kontrahent	Kredit-zins	Abrechnungs-datum	Fälligkeits-datum	Kredit-betrag	Verbindlichkeiten aus umgekehrten Pensions-geschäften	% des Nettovermögens
MYI	1,500 %	10.05.2023	TBD[1]	€ (547)	€ (549)	(0,09)
Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte					**€ (549)**	**(0,09)**

[1] Umgekehrtes Pensionsgeschäft mit offener Laufzeit.

Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC-Finanzderivate und -Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2023 und 31. Dezember 2022:

	Zum 30. Jun. 2023			Zum 31. Dez. 2022		
Kontrahent	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-Engagement[1]	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-Engagement[1]
BOA	€ 4	€ 0	€ 4	€ (60)	€ 0	€ (60)
BPS	11	0	11	40	0	40
BRC	(1)	0	(1)	15	0	15
CBK	0	0	0	(4)	0	(4)
GLM	k. A.	k. A.	k. A.	(1.545)	1.412	(133)
JPM	(63)	0	(63)	26	0	26
MBC	22	0	22	2.095	(1.900)	195
MYC	k. A.	k. A.	k. A.	(5)	0	(5)
MYI	44	0	44	(139)	(50)	(189)
RBC	0	0	0	(30)	0	(30)
SCX	(117)	0	(117)	18	0	18
SOG	889	(1.010)	(121)	k. A.	k. A.	k. A.
SSB	k. A.	k. A.	k. A.	292	0	292
UAG	k. A.	k. A.	k. A.	11	0	11

[1] Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären.

Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung des Wertpapierbestands zum 30. Juni 2023:

	30. Jun. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	81,20	72,82
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	5,47	7,71
Sonstige übertragbare Wertpapiere	k. A.	0,07
Investmentfonds	8,44	8,31
Pensionsgeschäfte	4,69	7,31
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	(0,08)	(0,47)
Zentral abgerechnete Finanzderivate	0,66	(0,30)
Freiverkehrsfinanzderivate	0,13	0,12
Umgekehrte Pensionsgeschäfte	(0,09)	k. A.

Das Anlageportfolio des Fonds konzentriert sich zum 30. Juni 2023 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	30. Jun. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
Kreditbeteiligungen und -abtretung	k. A.	1,36
Unternehmensanleihen und Wechsel	65,46	62,43
US-Regierungsbehörden	1,96	2,01
Non-Agency-MBS	3,18	4,11
Forderungsbesicherte Wertpapiere	4,01	5,19
Staatsemissionen	9,08	0,03
Kurzfristige Instrumente	2,98	5,47
Investmentfonds	8,44	8,31
Pensionsgeschäfte	4,69	7,31
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	(0,08)	(0,47)
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	(0,01)	(0,19)
Credit Default Swaps auf Kreditindizes—Schutzverkauf	0,03	0,02
Zinsswaps	0,64	(0,13)
Freiverkehrsfinanzderivate		
Verkaufsoptionen		
Credit Default Swaptions auf Kreditindizes	k. A.	0,00
Zinsswapoptionen	k. A.	(0,24)
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	k. A.	0,00
Devisenterminkontrakte	0,13	0,36
Sonstige Aktiva und Passiva	(0,51)	4,43
Nettovermögen	100,00	100,00

BESCHREIBUNG		PAR (000S)		MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE					
KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG					
Charter Communications Operating LLC					
6,795 % - 6,834 % fällig am 01.02.2027	$	2.721	€	2.482	0,19
SCUR-Alpha 1503 GmbH					
9,087 % fällig am 29.03.2030	€	1.200		1.147	0,09
10,602 % fällig am 28.03.2030	$	2.494		2.169	0,17
Sigma Bidco BV					
6,239 % fällig am 02.07.2025	€	1.300		1.275	0,10
Windstream Services LLC					
11,452 % fällig am 21.09.2027	$	2.907		2.494	0,20
Wm Morrison Supermarkets Ltd.					
8,073 % fällig am 04.11.2027	€	4.500		3.873	0,31
				13.440	1,06
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL					
BANKEN UND FINANZEN					
ABH Financial Ltd. Via Alfa Holding Issuance PLC					
2,700 % fällig am 11.06.2023 ^		8.200		1.230	0,10
ABN AMRO Bank NV					
2,470 % fällig am 13.12.2029	$	1.300		999	0,08
ADLER Real Estate AG					
3,000 % fällig am 27.04.2026	€	600		467	0,04
Altarea S.C.A.					
1,750 % fällig am 16.01.2030		1.500		1.048	0,08
1,875 % fällig am 17.01.2028		6.000		4.853	0,38
Aroundtown S.A.					
0,375 % fällig am 15.04.2027		1.900		1.367	0,11
1,450 % fällig am 09.07.2028		700		476	0,04
1,500 % fällig am 28.05.2026 (g)		11.000		9.079	0,72
5,375 % fällig am 21.03.2029	$	3.600		2.445	0,19
Atrium Finance PLC					
2,625 % fällig am 05.09.2027	€	2.200		1.604	0,13
Avolon Holdings Funding Ltd.					
2,875 % fällig am 15.02.2025	$	6.000		5.117	0,41
Balder Finland Oyj					
1,000 % fällig am 20.01.2029	€	800		511	0,04
2,000 % fällig am 18.01.2031		6.500		3.896	0,31
Banca Monte dei Paschi di Siena SpA					
3,625 % fällig am 24.09.2024		8.500		8.260	0,65
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A.					
6,138 % fällig am 14.09.2028	$	1.100		1.011	0,08
Barclays PLC					
7,437 % fällig am 02.11.2033		24.076		23.887	1,89
BNP Paribas S.A.					
1,904 % fällig am 30.09.2028		2.300		1.798	0,14
BPCE S.A.					
5,748 % fällig am 19.07.2033		12.100		10.839	0,86
Castellum Helsinki Finance Holding Abp					
0,875 % fällig am 17.09.2029	€	4.700		3.218	0,26
2,000 % fällig am 24.03.2025		5.500		5.057	0,40
Citycon Treasury BV					
1,625 % fällig am 12.03.2028		10.600		7.748	0,61
Corestate Capital Holding S.A.					
3,500 % fällig am 31.07.2023 ^		11.600		1.639	0,13
Country Garden Holdings Co. Ltd.					
2,700 % fällig am 12.07.2026	$	2.600		730	0,06
3,125 % fällig am 22.10.2025		1.500		433	0,03
CPI Property Group S.A.					
1,625 % fällig am 23.04.2027	€	9.300		6.798	0,54
2,750 % fällig am 12.05.2026		100		81	0,01
Credit Suisse AG					
6,500 % fällig am 08.08.2023 (e)	$	11.200		10.228	0,81
Cromwell Ereit Lux Finco SARL					
2,125 % fällig am 19.11.2025	€	10.000		8.631	0,68
CTP NV					
0,625 % fällig am 27.09.2026		1.600		1.294	0,10
1,250 % fällig am 21.06.2029		7.000		5.085	0,40
1,500 % fällig am 27.09.2031		1.500		1.047	0,08
Deutsche Bank AG					
1,375 % fällig am 17.02.2032		700		519	0,04
1,750 % fällig am 19.11.2030		6.200		4.906	0,39
2,129 % fällig am 24.11.2026 (f)	$	2.800		2.285	0,18
2,552 % fällig am 07.01.2028		3.600		2.864	0,23
3,035 % fällig am 28.05.2032 (f)	$	200	€	144	0,01
3,547 % fällig am 18.09.2031		1.100		838	0,07
Digital Euro Finco LLC					
1,125 % fällig am 09.04.2028	€	1.300		1.074	0,09
Digital Intrepid Holding BV					
0,625 % fällig am 15.07.2031		800		557	0,04
1,375 % fällig am 18.07.2032		7.500		5.377	0,43
DVI Deutsche Vermögens- & Immobilienverwaltungs GmbH					
2,500 % fällig am 25.01.2027		6.400		4.861	0,39
EQT AB					
2,375 % fällig am 06.04.2028		1.300		1.147	0,09
G City Europe Ltd.					
4,250 % fällig am 11.09.2025		6.400		5.600	0,44
Globalworth Real Estate Investments Ltd.					
3,000 % fällig am 29.03.2025		6.600		5.462	0,43
HSBC Holdings PLC					
2,099 % fällig am 04.06.2026	$	600		509	0,04
3,973 % fällig am 22.05.2030		1.800		1.483	0,12
5,402 % fällig am 11.08.2033		12.000		10.760	0,85
Intesa Sanpaolo SpA					
8,248 % fällig am 21.11.2033		14.275		13.752	1,09
Jyske Realkredit A/S					
0,500 % fällig am 01.10.2043	DKK	0		0	0,00
1,000 % fällig am 01.10.2050		0		0	0,00
1,000 % fällig am 01.10.2053		0		0	0,00
1,500 % fällig am 01.10.2037		0		0	0,00
1,500 % fällig am 01.10.2050		0		0	0,00
Kaisa Group Holdings Ltd.					
10,875 % fällig am 23.07.2023 ^	$	5.400		315	0,03
11,500 % fällig am 30.01.2023 ^		3.500		215	0,02
11,650 % fällig am 01.06.2026 ^		4.000		245	0,02
KBC Group NV					
5,796 % fällig am 19.01.2029		2.000		1.822	0,14
Kennedy Wilson Europe Real Estate Ltd.					
3,250 % fällig am 12.11.2025	€	5.800		5.147	0,41
Logicor Financing SARL					
1,500 % fällig am 13.07.2026		2.600		2.247	0,18
1,625 % fällig am 17.01.2030		3.600		2.668	0,21
NatWest Group PLC					
6,016 % fällig am 02.03.2034	$	12.200		11.250	0,89
Nordea Kredit Realkreditaktieselskab					
0,500 % fällig am 01.10.2043	DKK	0		0	0,00
1,000 % fällig am 01.10.2050		0		0	0,00
1,000 % fällig am 01.10.2053		0		0	0,00
1,500 % fällig am 01.10.2050		0		0	0,00
Nykredit Realkredit A/S					
0,500 % fällig am 01.10.2043		0		0	0,00
1,000 % fällig am 01.10.2050		0		0	0,00
1,000 % fällig am 01.10.2053		0		0	0,00
1,500 % fällig am 01.10.2037		0		0	0,00
1,500 % fällig am 01.10.2050		0		0	0,00
2,500 % fällig am 01.10.2036		0		0	0,00
Realkredit Danmark A/S					
2,500 % fällig am 01.04.2036		0		0	0,00
Sagax AB					
1,125 % fällig am 30.01.2027	€	7.082		5.977	0,47
2,000 % fällig am 17.01.2024		332		325	0,03
2,250 % fällig am 13.03.2025		5.100		4.819	0,38
Sagax Euro MTN NL BV					
0,750 % fällig am 26.01.2028		1.400		1.062	0,08
1,000 % fällig am 17.05.2029		1.700		1.212	0,10
Santander UK Group Holdings PLC					
2,896 % fällig am 15.03.2032	$	13.185		9.781	0,78
Sirius Real Estate Ltd.					
1,125 % fällig am 22.06.2026	€	3.700		3.059	0,24
1,750 % fällig am 24.11.2028		3.500		2.500	0,20
Societe Generale S.A.					
2,797 % fällig am 19.01.2028	$	10.800		8.777	0,70
6,446 % fällig am 10.01.2029		7.700		7.076	0,56
6,691 % fällig am 10.01.2034		300		280	0,02
Sunac China Holdings Ltd.					
5,950 % fällig am 26.04.2024 ^		2.200		303	0,02
6,500 % fällig am 26.01.2026 ^		4.200		582	0,05
UBS Group AG					
3,750 % fällig am 26.03.2025		1.550		1.361	0,11
7,750 % fällig am 01.03.2029	€	6.400		7.098	0,56
UniCredit SpA					
1,982 % fällig am 03.06.2027	$	500	€	404	0,03
3,127 % fällig am 03.06.2032		6.000		4.342	0,34
Yango Justice International Ltd.					
7,875 % fällig am 04.09.2024 ^		12.600		173	0,01
				276.054	21,87
INDUSTRIEWERTE					
Altice Financing S.A.					
5,750 % fällig am 15.08.2029		6.000		4.266	0,34
Altice France S.A.					
3,375 % fällig am 15.01.2028	€	5.000		3.662	0,29
DISH DBS Corp.					
5,250 % fällig am 01.12.2026	$	473		348	0,03
Fortune Star BVI Ltd.					
3,950 % fällig am 02.10.2026	€	10.100		6.969	0,55
Las Vegas Sands Corp.					
2,900 % fällig am 25.06.2025	$	1.600		1.379	0,11
Lendlease Europe Finance PLC					
3,500 % fällig am 02.12.2033	£	164		125	0,01
Mitchells & Butlers Finance PLC					
5,451 % fällig am 15.12.2030		427		462	0,04
6,002 % fällig am 15.12.2030	$	738		623	0,05
Nissan Motor Co. Ltd.					
4,345 % fällig am 17.09.2027		1.200		1.001	0,08
Q-Park Holding BV					
3,500 % fällig am 01.02.2025	€	7.800		7.302	0,58
Roadster Finance DAC					
1,625 % fällig am 09.12.2029		200		183	0,01
2,375 % fällig am 08.12.2032		400		330	0,02
Syngenta Finance NV					
4,892 % fällig am 24.04.2025	$	6.564		5.893	0,47
Ubisoft Entertainment S.A.					
0,878 % fällig am 24.11.2027	€	8.600		6.610	0,52
Windstream Escrow LLC					
7,750 % fällig am 15.08.2028	$	1.800		1.371	0,11
				40.524	3,21
VERSORGUNGSUNTERNEHMEN					
Pacific Gas & Electric Co.					
6,100 % fällig am 15.01.2029		5.000		4.513	0,36
6,400 % fällig am 15.06.2033		5.000		4.561	0,36
6,750 % fällig am 15.01.2053		3.000		2.717	0,22
				11.791	0,94
Summe Unternehmensanleihen und Wechsel				328.369	26,02
WANDELANLEIHEN & WECHSEL					
Corestate Capital Holding S.A.					
1,375 % fällig am 31.07.2023 ^	€	7.800		1.135	0,09
US-REGIERUNGSBEHÖRDEN					
Ginnie Mae, TBA					
5,000 % fällig am 01.07.2053	$	3.100		2.792	0,22
Uniform Mortgage-Backed Security					
3,000 % fällig am 01.05.2052		1.295		1.047	0,08
Uniform Mortgage-Backed Security, TBA					
3,000 % fällig am 01.08.2053		23.900		19.311	1,53
5,000 % fällig am 01.08.2053		29.100		26.144	2,07
5,500 % fällig am 01.08.2053		92.300		84.185	6,67
6,000 % fällig am 01.08.2053		268.100		247.869	19,64
6,500 % fällig am 01.07.2053		55.400		51.826	4,11
				433.174	34,32
NON-AGENCY-MBS					
Alba PLC					
5,261 % fällig am 15.12.2038	£	1.519		1.638	0,13
American Home Mortgage Assets Trust					
4,896 % fällig am 25.11.2046	$	446		126	0,01
5,360 % fällig am 25.12.2046		1.355		1.038	0,08
Atlas Funding PLC					
5,432 % fällig am 25.07.2058	£	701		816	0,07
Atrium Hotel Portfolio Trust					
7,093 % fällig am 15.06.2035	$	9.700		8.482	0,67

BESCHREIBUNG		PAR (000S)		MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
Banc of America Alternative Loan Trust					
1,490 % fällig am 25.06.2037 ^(a)	$	237	€	18	0,00
5,500 % fällig am 25.10.2033		174		153	0,01
5,510 % fällig am 25.06.2037		219		149	0,01
6,000 % fällig am 25.07.2046 ^		216		167	0,01
Banc of America Funding Trust					
3,811 % fällig am 20.09.2046 ^		39		31	0,00
4,106 % fällig am 20.04.2035 ^		53		43	0,00
4,245 % fällig am 20.11.2035 ^		72		59	0,01
4,287 % fällig am 20.09.2046 ^		24		21	0,00
5,537 % fällig am 20.10.2036		69		51	0,00
5,570 % fällig am 25.04.2037 ^		62		47	0,00
6,000 % fällig am 25.08.2037 ^		250		180	0,02
Banc of America Mortgage Trust					
6,000 % fällig am 25.10.2036 ^		9		7	0,00
BCAP LLC Trust					
3,857 % fällig am 26.03.2037		59		43	0,00
4,048 % fällig am 27.03.2037		225		170	0,01
5,500 % fällig am 25.11.2034 ^		13		9	0,00
Bear Stearns Adjustable Rate Mortgage Trust					
4,375 % fällig am 25.02.2035		6		5	0,00
4,791 % fällig am 25.08.2035		5		4	0,00
6,662 % fällig am 25.12.2046 ^		172		128	0,01
Bear Stearns ALT-A Trust					
3,731 % fällig am 25.11.2036 ^		67		29	0,00
3,859 % fällig am 25.09.2035 ^		146		55	0,01
3,971 % fällig am 25.05.2036 ^		295		137	0,01
4,941 % fällig am 25.07.2035 ^		326		218	0,02
Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust					
5,750 % fällig am 25.11.2034 ^		166		131	0,01
Bear Stearns Mortgage Funding Trust					
7,500 % fällig am 25.08.2036		3		3	0,00
Bridgegate Funding PLC					
6,716 % fällig am 16.10.2062	£	24.122		28.078	2,23
BX Trust					
7,213 % fällig am 15.05.2030	$	1.015		911	0,07
8,468 % fällig am 15.07.2034		1.624		1.485	0,12
9,568 % fällig am 15.07.2034		3.400		3.102	0,25
Chase Mortgage Finance Trust					
3,814 % fällig am 25.01.2036 ^		194		152	0,01
3,848 % fällig am 25.03.2037 ^		22		18	0,00
6,000 % fällig am 25.05.2037 ^		96		43	0,00
ChaseFlex Trust					
5,000 % fällig am 25.07.2037 ^		71		22	0,00
ChaseFlex Trust Multi-Class Mortgage Pass-Through Certificates Trust					
4,176 % fällig am 25.08.2037 ^		22		17	0,00
Citigroup Mortgage Loan Trust					
3,857 % fällig am 25.03.2037 ^		40		32	0,00
4,041 % fällig am 25.04.2037 ^		168		131	0,01
5,480 % fällig am 25.12.2034		4		3	0,00
5,500 % fällig am 25.12.2035		109		56	0,01
6,250 % fällig am 25.11.2037		139		61	0,01
CitiMortgage Alternative Loan Trust					
6,000 % fällig am 25.01.2037 ^		216		176	0,01
6,000 % fällig am 25.06.2037 ^		357		283	0,02
Countrywide Alternative Loan Resecuritization Trust					
5,019 % fällig am 25.08.2037 ^		56		25	0,00
6,000 % fällig am 25.08.2037 ^		49		23	0,00
Countrywide Alternative Loan Trust					
3,842 % fällig am 25.05.2036		11		8	0,00
3,897 % fällig am 25.09.2034		4		3	0,00
3,994 % fällig am 25.06.2037 ^		47		38	0,00
5,500 % fällig am 25.03.2035		5.356		4.276	0,34
5,500 % fällig am 25.11.2035		75		43	0,00
5,500 % fällig am 25.12.2035 ^		62		32	0,00
5,500 % fällig am 25.02.2036 ^		47		26	0,00
5,750 % fällig am 25.04.2047 ^		97		51	0,00
6,000 % fällig am 25.03.2036 ^		200		85	0,01
6,000 % fällig am 25.05.2036 ^		985		476	0,04
6,000 % fällig am 25.05.2036		149		78	0,01
6,000 % fällig am 25.08.2036 ^		31		18	0,00
6,000 % fällig am 25.08.2036 ^		161		91	0,01
6,000 % fällig am 25.04.2037 ^		59		32	0,00
6,000 % fällig am 25.05.2037 ^		783		349	0,03
6,000 % fällig am 25.08.2037 ^		314		151	0,01
6,250 % fällig am 25.07.2036 ^		1.351		612	0,05
6,250 % fällig am 25.12.2036 ^		20		9	0,00
6,500 % fällig am 25.12.2036 ^		59		26	0,00
6,500 % fällig am 25.08.2037 ^	$	339	€	136	0,01
Countrywide Asset-Backed Certificates Trust					
5,630 % fällig am 25.04.2036 ^		159		123	0,01
Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust					
3,611 % fällig am 25.09.2047 ^		64		52	0,00
3,677 % fällig am 20.02.2036		133		105	0,01
3,842 % fällig am 25.01.2036 ^		29		24	0,00
3,861 % fällig am 20.12.2035 ^		53		41	0,00
3,876 % fällig am 25.11.2037		87		70	0,01
4,239 % fällig am 20.09.2036 ^		23		19	0,00
5,750 % fällig am 25.03.2035		262		164	0,01
5,750 % fällig am 25.12.2035 ^		65		30	0,00
5,770 % fällig am 25.03.2035		16		12	0,00
5,890 % fällig am 25.02.2035		177		140	0,01
6,000 % fällig am 25.03.2037 ^		92		41	0,00
6,000 % fällig am 25.04.2037 ^		14		6	0,00
6,000 % fällig am 25.07.2037		161		69	0,01
6,500 % fällig am 25.11.2036 ^		263		92	0,01
Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp.					
6,000 % fällig am 25.01.2036 ^		160		94	0,01
6,300 % fällig am 25.09.2034 ^		22		27	0,00
Credit Suisse Mortgage Capital Mortgage-Backed Trust					
5,450 % fällig am 25.08.2036 ^		1.199		297	0,02
6,000 % fällig am 25.07.2036		183		89	0,01
6,500 % fällig am 25.10.2021 ^		199		12	0,00
6,500 % fällig am 25.02.2022 ^		513		58	0,01
Credit Suisse Mortgage Capital Trust					
7,093 % fällig am 15.07.2032		1.024		852	0,07
Deutsche ALT-B Securities Mortgage Loan Trust					
5,450 % fällig am 25.04.2037		180		111	0,01
Deutsche Mortgage Securities, Inc. Re-REMIC Trust Certificates					
4,057 % fällig am 27.06.2037		2.915		2.373	0,19
Dutch Property Finance BV					
3,992 % fällig am 28.10.2059	€	6.819		6.793	0,54
4,168 % fällig am 28.04.2064		15.994		16.033	1,27
EuroMASTR PLC					
5,205 % fällig am 15.06.2040	£	120		129	0,01
First Horizon Alternative Mortgage Securities Trust					
4,802 % fällig am 25.01.2036 ^	$	141		69	0,01
5,229 % fällig am 25.04.2036 ^		46		36	0,00
First Horizon Mortgage Pass-Through Trust					
4,283 % fällig am 25.11.2037 ^		28		22	0,00
Glenbeigh Issuer DAC					
4,350 % fällig am 24.06.2050	€	13.380		13.317	1,06
GSC Capital Corp. Mortgage Trust					
5,510 % fällig am 25.05.2036 ^	$	64		54	0,01
GSR Mortgage Loan Trust					
5,500 % fällig am 25.06.2035		100		90	0,01
HarborView Mortgage Loan Trust					
3,784 % fällig am 19.12.2035 ^		84		42	0,00
4,032 % fällig am 19.06.2036 ^		90		47	0,00
4,596 % fällig am 19.12.2035 ^		16		14	0,00
Harbour					
5,457 % fällig am 28.01.2054	£	5.700		6.552	0,52
Hops Hill PLC					
5,854 % fällig am 27.05.2054		866		1.010	0,08
HSI Asset Loan Obligation Trust					
6,000 % fällig am 25.06.2037 ^	$	74		59	0,01
Impac Secured Assets Trust					
5,450 % fällig am 25.11.2036		40		37	0,00
IndyMac Mortgage Loan Trust					
3,367 % fällig am 25.06.2036		39		28	0,00
3,510 % fällig am 25.11.2035 ^		81		65	0,01
3,747 % fällig am 25.06.2037 ^		1.064		677	0,05
5,400 % fällig am 25.09.2037		3.873		3.476	0,28
5,770 % fällig am 25.10.2036		9.556		4.848	0,38
5,870 % fällig am 25.01.2035		46		30	0,00
6,250 % fällig am 25.11.2037 ^		42		18	0,00
JPMorgan Alternative Loan Trust					
3,790 % fällig am 25.12.2036		4		3	0,00
5,630 % fällig am 25.10.2036		2.810		2.300	0,18
5,660 % fällig am 27.06.2037		169		112	0,01
6,500 % fällig am 25.03.2036 ^		183		98	0,01
6,550 % fällig am 25.05.2036		4		3	0,00
Jubilee Place BV					
4,027 % fällig am 17.01.2059	€	5.474		5.462	0,43
4,177 % fällig am 17.10.2057		1.197		1.197	0,10
Jupiter Mortgage PLC					
5,891 % fällig am 20.07.2060	£	24.700	€	28.702	2,27
Lavender Trust					
6,250 % fällig am 26.10.2036	$	165		79	0,01
Lehman Mortgage Trust					
4,599 % fällig am 25.12.2035		159		29	0,00
5,039 % fällig am 25.01.2036 ^		46		38	0,00
Lehman XS Trust					
5,510 % fällig am 25.12.2036		723		643	0,05
Ludgate Funding PLC					
3,212 % fällig am 01.01.2061	€	5.036		4.813	0,38
3,654 % fällig am 01.12.2060		3.036		2.912	0,23
Mansard Mortgages PLC					
5,651 % fällig am 15.12.2049	£	39		45	0,00
MASTR Adjustable Rate Mortgages Trust					
3,515 % fällig am 25.03.2035	$	13		10	0,00
Merrill Lynch Alternative Note Asset Trust					
6,000 % fällig am 25.05.2037 ^		124		89	0,01
Merrill Lynch Mortgage Investors Trust					
3,738 % fällig am 25.03.2036 ^		267		138	0,01
Miravet SARL					
4,265 % fällig am 26.05.2065	€	5.263		5.182	0,41
Morgan Stanley Mortgage Loan Trust					
4,148 % fällig am 25.03.2036 ^	$	106		62	0,01
5,962 % fällig am 25.06.2036 ^		4.377		1.214	0,10
6,000 % fällig am 25.10.2037 ^		112		62	0,01
6,201 % fällig am 25.02.2047		3.017		1.057	0,08
Newgate Funding PLC					
4,126 % fällig am 15.12.2050	€	193		186	0,02
4,600 % fällig am 01.12.2050	£	1.107		1.234	0,10
6,005 % fällig am 15.12.2050		153		171	0,01
Nomura Resecuritization Trust					
6,050 % fällig am 25.03.2037	$	3.626		3.180	0,25
Primrose Residential DAC					
4,439 % fällig am 24.10.2061	€	4.667		4.623	0,37
Residential Accredit Loans, Inc. Trust					
5,570 % fällig am 25.06.2037	$	51		40	0,00
6,000 % fällig am 25.06.2036 ^		57		42	0,00
6,000 % fällig am 25.05.2037 ^		46		34	0,00
6,250 % fällig am 25.02.2037 ^		123		92	0,01
Residential Asset Securitization Trust					
6,000 % fällig am 25.02.2036		322		136	0,01
6,000 % fällig am 25.06.2036		145		58	0,01
6,000 % fällig am 25.11.2036 ^		121		43	0,00
6,000 % fällig am 25.03.2037 ^		97		31	0,00
6,000 % fällig am 25.05.2037 ^		644		338	0,03
6,250 % fällig am 25.11.2036 ^		83		30	0,00
Residential Funding Mortgage Securities, Inc. Trust					
6,000 % fällig am 25.10.2036 ^		49		34	0,00
RMAC Securities PLC					
3,756 % fällig am 12.06.2044	€	3.868		3.611	0,29
5,154 % fällig am 12.06.2044	£	412		459	0,04
5,254 % fällig am 12.06.2044		4.103		4.494	0,36
Shamrock Residential DAC					
4,439 % fällig am 24.06.2071	€	14.592		14.446	1,15
Southern Pacific Securities PLC					
4,016 % fällig am 10.03.2044		2.548		2.514	0,20
Stratton Mortgage Funding PLC					
6,991 % fällig am 20.07.2060	£	5.594		6.428	0,51
Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust					
4,200 % fällig am 25.02.2036 ^	$	53		39	0,00
4,968 % fällig am 25.10.2035 ^		119		97	0,01
SunTrust Adjustable Rate Mortgage Loan Trust					
4,078 % fällig am 25.02.2037 ^		75		59	0,01
TBW Mortgage-Backed Trust					
6,300 % fällig am 25.03.2037		8.467		1.884	0,15
Tower Bridge Funding PLC					
5,991 % fällig am 20.10.2064	£	10.400		12.188	0,97
7,641 % fällig am 20.10.2064		2.300		2.694	0,21
UBS Commercial Mortgage Trust					
6,693 % fällig am 15.02.2032	$	7.520		6.654	0,53
Uropa Securities PLC					
3,405 % fällig am 10.10.2040	€	1.612		1.497	0,12
WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust					
3,633 % fällig am 25.12.2036 ^	$	238		189	0,02
3,712 % fällig am 25.10.2036 ^		30		24	0,00

BESCHREIBUNG		PAR (000S)		MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
3,765 % fällig am 25.12.2035	$	10	€	9	0,00
3,974 % fällig am 25.05.2037 ^		43		35	0,00
5,930 % fällig am 25.10.2044		56		48	0,00
Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates Trust					
4,746 % fällig am 25.04.2047		355		258	0,02
6,000 % fällig am 25.07.2036 ^		95		61	0,01
6,000 % fällig am 25.06.2037 ^		25		21	0,00
Wells Fargo Alternative Loan Trust					
6,250 % fällig am 25.11.2037 ^		29		23	0,00
				235.717	18,68

FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE

BESCHREIBUNG		PAR (000S)		MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
Accunia European CLO DAC					
4,127 % fällig am 15.07.2030	€	568		560	0,04
ACE Securities Corp. Home Equity Loan Trust					
5,370 % fällig am 25.10.2036	$	1.881		657	0,05
5,370 % fällig am 25.12.2036		411		101	0,01
5,430 % fällig am 25.07.2036		105		74	0,01
5,430 % fällig am 25.02.2037		2.800		1.113	0,09
5,450 % fällig am 25.01.2037		6.947		3.469	0,28
6,125 % fällig am 25.11.2033		719		632	0,05
ALME Loan Funding DAC					
3,927 % fällig am 15.01.2032	€	291		286	0,02
Ameriquest Mortgage Securities Trust					
5,390 % fällig am 25.10.2036	$	3.163		879	0,07
Ameriquest Mortgage Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates					
3,425 % fällig am 25.04.2034		1.412		1.271	0,10
5,870 % fällig am 25.07.2035		1.599		1.451	0,12
Aqueduct European CLO DAC					
3,840 % fällig am 20.07.2030	€	2.765		2.729	0,22
4,253 % fällig am 15.08.2034		1.000		974	0,08
Ares European CLO DAC					
3,837 % fällig am 15.10.2030		696		683	0,05
4,050 % fällig am 20.04.2032		2.100		2.061	0,16
4,325 % fällig am 21.10.2033		8.500		8.360	0,66
Argent Securities Trust					
5,300 % fällig am 25.09.2036	$	855		258	0,02
5,350 % fällig am 25.06.2036		463		119	0,01
Argent Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates					
5,790 % fällig am 25.01.2036		474		384	0,03
Asset-Backed Funding Certificates Trust					
6,150 % fällig am 25.06.2037		72		51	0,00
6,200 % fällig am 25.03.2034 ^		113		97	0,01
Aurium CLO DAC					
3,847 % fällig am 16.04.2030	€	2.082		2.044	0,16
Bain Capital Euro CLO DAC					
4,311 % fällig am 24.01.2033		400		392	0,03
Bastille Euro CLO DAC					
4,327 % fällig am 15.01.2034		8.200		7.989	0,63
Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust					
3,945 % fällig am 25.10.2036	$	33		14	0,00
6,050 % fällig am 25.08.2034		899		793	0,06
Blackrock European CLO DAC					
4,426 % fällig am 15.12.2032	€	600		584	0,05
BlueMountain Fuji EUR CLO DAC					
3,827 % fällig am 15.07.2030		2.352		2.310	0,18
4,087 % fällig am 15.01.2033		2.300		2.242	0,18
BNPP AM Euro CLO DAC					
3,827 % fällig am 15.10.2031		1.133		1.108	0,09
BNPP IP Euro CLO DAC					
3,967 % fällig am 15.10.2030		1.000		982	0,08
Bosphorus CLO DAC					
4,346 % fällig am 15.12.2030		882		868	0,07
Cairn CLO DAC					
3,912 % fällig am 31.01.2030		4.176		4.112	0,33
4,051 % fällig am 25.07.2029		1.514		1.512	0,12
4,212 % fällig am 20.10.2028		32		32	0,00
Carlyle Euro CLO DAC					
3,953 % fällig am 15.08.2030		5.795		5.666	0,45
Carlyle Global Market Strategies Euro CLO DAC					
3,927 % fällig am 15.07.2030		1.227		1.210	0,10
Carrington Mortgage Loan Trust					
5,410 % fällig am 25.02.2037	$	143		119	0,01
Centex Home Equity Loan Trust					
6,200 % fällig am 25.10.2035	$	4.024	€	3.527	0,28
Citigroup Mortgage Loan Trust					
6,851 % fällig am 25.05.2036 ^		129		47	0,00
Contego CLO BV					
3,947 % fällig am 15.10.2030	€	1.298		1.278	0,10
Contego CLO DAC					
3,851 % fällig am 23.01.2030		5.535		5.425	0,43
Countrywide Asset-Backed Certificates Trust					
5,430 % fällig am 25.12.2046	$	3.298		2.772	0,22
5,690 % fällig am 25.03.2036		1.050		831	0,07
Credit-Based Asset Servicing & Securitization Trust					
3,156 % fällig am 25.01.2037 ^		2.093		600	0,05
CVC Cordatus Loan Fund DAC					
3,855 % fällig am 21.07.2030	€	10.744		10.567	0,84
4,103 % fällig am 15.08.2032		199		195	0,02
4,305 % fällig am 26.08.2032		500		489	0,04
4,447 % fällig am 17.06.2032		1.300		1.271	0,10
Dryden Euro CLO DAC					
4,073 % fällig am 15.05.2032		579		564	0,04
4,183 % fällig am 15.05.2034		300		294	0,02
Fieldstone Mortgage Investment Trust					
5,930 % fällig am 25.12.2035	$	5.000		3.880	0,31
First NLC Trust					
5,290 % fällig am 25.08.2037		139		65	0,01
5,430 % fällig am 25.08.2037		46		22	0,00
Fremont Home Loan Trust					
5,270 % fällig am 25.01.2037		10.377		4.399	0,35
5,300 % fällig am 25.01.2037		214		91	0,01
5,470 % fällig am 25.08.2036		185		57	0,00
5,490 % fällig am 25.02.2037		650		205	0,02
6,020 % fällig am 25.11.2034		1.297		1.031	0,08
6,080 % fällig am 25.04.2035		3.128		2.739	0,22
Griffith Park CLO DAC					
4,103 % fällig am 21.11.2031	€	3.300		3.238	0,26
GSAA Home Equity Trust					
5,772 % fällig am 25.11.2036 ^	$	124		35	0,00
GSAMP Trust					
5,250 % fällig am 25.12.2046		185		85	0,01
5,290 % fällig am 25.12.2036		843		418	0,03
5,300 % fällig am 25.12.2046		508		234	0,02
5,350 % fällig am 25.11.2036		190		84	0,01
5,380 % fällig am 25.12.2046		92		43	0,00
5,450 % fällig am 25.09.2036		355		118	0,01
Harvest CLO DAC					
3,817 % fällig am 15.10.2031	€	1.400		1.367	0,11
3,907 % fällig am 15.01.2031		931		915	0,07
4,150 % fällig am 20.10.2032		2.000		1.948	0,15
4,252 % fällig am 18.11.2030		2.217		2.176	0,17
HSI Asset Securitization Corp. Trust					
5,370 % fällig am 25.12.2036	$	198		49	0,00
5,490 % fällig am 25.12.2036		953		235	0,02
5,525 % fällig am 25.05.2037		4.600		4.043	0,32
5,590 % fällig am 25.12.2036		552		137	0,01
JPMorgan Mortgage Acquisition Corp.					
6,080 % fällig am 25.06.2035		4.968		4.091	0,32
JPMorgan Mortgage Acquisition Trust					
6,337 % fällig am 25.08.2036 ^		90		49	0,00
Jubilee CLO DAC					
3,787 % fällig am 15.04.2030	€	700		686	0,05
4,326 % fällig am 15.12.2029		949		938	0,07
Lehman XS Trust					
5,320 % fällig am 25.02.2037 ^	$	977		673	0,05
Mackay Shields Euro CLO DAC					
4,130 % fällig am 20.10.2032	€	1.300		1.267	0,10
Man GLG Euro CLO DAC					
3,857 % fällig am 15.10.2030		513		504	0,04
4,047 % fällig am 15.01.2030		3.078		3.040	0,24
Marlay Park CLO DAC					
3,917 % fällig am 15.10.2030		1.301		1.282	0,10
MASTR Asset-Backed Securities Trust					
5,250 % fällig am 25.11.2036	$	136		41	0,00
5,450 % fällig am 25.08.2036		236		85	0,01
5,630 % fällig am 25.06.2036		128		45	0,00
5,630 % fällig am 25.08.2036		141		51	0,00
Merrill Lynch Mortgage Investors Trust					
5,450 % fällig am 25.11.2037		610		197	0,02
5,690 % fällig am 25.04.2047		1.539		588	0,05
Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust					
5,260 % fällig am 25.02.2037	$	477	€	140	0,01
5,280 % fällig am 25.01.2037		98		41	0,00
5,290 % fällig am 25.10.2036		107		43	0,00
5,330 % fällig am 25.03.2037		321		130	0,01
5,350 % fällig am 25.09.2036		55		19	0,00
5,350 % fällig am 25.02.2037		109		48	0,00
5,400 % fällig am 25.03.2037		321		130	0,01
5,450 % fällig am 25.09.2036		328		113	0,01
6,125 % fällig am 25.02.2035		2.379		1.557	0,12
6,200 % fällig am 25.06.2033		4		4	0,00
Morgan Stanley Home Equity Loan Trust					
5,320 % fällig am 25.04.2037		260		125	0,01
Morgan Stanley Mortgage Loan Trust					
5,680 % fällig am 25.04.2037		2.307		774	0,06
5,690 % fällig am 25.04.2037		2.307		774	0,06
6,465 % fällig am 25.09.2046 ^		285		89	0,01
Nomura Home Equity Loan, Inc. Home Equity Loan Trust					
6,532 % fällig am 25.10.2036 ^		154		34	0,00
NovaStar Mortgage Funding Trust					
5,450 % fällig am 25.06.2036		82		53	0,00
5,450 % fällig am 25.09.2036		149		59	0,00
5,470 % fällig am 25.05.2036		283		254	0,02
Oak Hill European Credit Partners DAC					
3,930 % fällig am 20.01.2032	€	2.940		2.875	0,23
Oak Hill European Credit Partners Ltd.					
4,100 % fällig am 22.07.2030		1.267		1.262	0,10
OCP Euro CLO DAC					
3,997 % fällig am 15.01.2032		4.688		4.628	0,37
Option One Mortgage Loan Trust					
5,250 % fällig am 25.07.2036	$	10.557		4.349	0,34
5,330 % fällig am 25.04.2037		13.384		6.928	0,55
5,370 % fällig am 25.01.2037		256		135	0,01
5,480 % fällig am 25.04.2037		99		45	0,00
Palmer Square European Loan Funding DAC					
3,897 % fällig am 15.10.2031	€	5.535		5.425	0,43
Palmerston Park CLO DAC					
3,825 % fällig am 18.04.2030		1.259		1.242	0,10
Park Place Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates					
5,885 % fällig am 25.08.2035	$	399		351	0,03
Purple Finance CLO DAC					
4,200 % fällig am 20.04.2032	€	1.200		1.177	0,09
Renaissance Home Equity Loan Trust					
5,879 % fällig am 25.06.2037 ^	$	3.494		962	0,08
6,950 % fällig am 25.09.2037		144		110	0,01
7,238 % fällig am 25.09.2037 ^		212		85	0,01
Residential Asset Mortgage Products Trust					
6,095 % fällig am 25.10.2035		3.000		2.240	0,18
Residential Asset Securities Corp. Trust					
5,410 % fällig am 25.11.2036		687		579	0,05
6,110 % fällig am 25.01.2036		3.300		2.703	0,21
Rockford Tower Europe CLO DAC					
4,577 % fällig am 20.12.2031	€	559		549	0,04
Securitized Asset-Backed Receivables LLC Trust					
5,330 % fällig am 25.07.2036	$	192		62	0,01
5,470 % fällig am 25.07.2036		188		60	0,01
5,630 % fällig am 25.07.2036		161		52	0,00
5,650 % fällig am 25.03.2036		3.048		1.752	0,14
5,650 % fällig am 25.05.2036		661		326	0,03
Segovia European CLO DAC					
3,945 % fällig am 18.01.2031	€	264		259	0,02
4,080 % fällig am 20.07.2032		2.000		1.949	0,15
Soundview Home Loan Trust					
3,904 % fällig am 25.04.2035	$	1.588		1.423	0,11
5,260 % fällig am 25.02.2037		263		69	0,01
5,330 % fällig am 25.02.2037		388		102	0,01
5,430 % fällig am 25.06.2037		138		85	0,01
5,825 % fällig am 25.06.2035		2.718		2.405	0,19
6,150 % fällig am 25.09.2037		7.798		4.858	0,39
Specialty Underwriting & Residential Finance Trust					
5,450 % fällig am 25.09.2037		65		41	0,00
St. Paul's CLO DAC					
3,937 % fällig am 17.07.2030	€	1.494		1.470	0,12
Structured Asset Investment Loan Trust					
5,300 % fällig am 25.09.2036	$	25		22	0,00

BESCHREIBUNG		PAR (000S)		MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust					
6,900 % fällig am 25.04.2031	$	1.879	€	1.704	0,14
Toro European CLO DAC					
3,917 % fällig am 15.10.2030	€	1.103		1.082	0,09
3,995 % fällig am 12.01.2032		9.200		9.023	0,72
4,097 % fällig am 15.07.2030		1.515		1.504	0,12
Voya Euro CLO DAC					
3,927 % fällig am 15.10.2030		4.121		4.069	0,32
				199.546	15,81
STAATSEMISSIONEN					
Russia Government International Bond					
2,875 % fällig am 04.12.2025 ^		4.000		2.330	0,18
Ukraine Government International Bond					
7,750 % fällig am 01.09.2025 ^	$	6.500		1.521	0,12
				3.851	0,30
KURZFRISTIGE INSTRUMENTE					
KURZFRISTIGE SCHULDTITEL					
Corestate Capital Holding S.A.					
15,000 % fällig am 31.07.2023 (f)	€	700		707	0,06
BELGIUM TREASURY BILLS					
2,979 % fällig am 13.07.2023 (b)(c)		1.600		1.599	0,13
3,039 % fällig am 13.07.2023 (b)(c)		5.180		5.176	0,41
3,369 % fällig am 14.09.2023 (b)(c)		3.790		3.764	0,30
3,411 % fällig am 14.09.2023 (b)(c)		3.040		3.019	0,24
3,421 % fällig am 14.09.2023 (b)(c)		2.260		2.245	0,18

BESCHREIBUNG		PAR (000S)		MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
3,424 % fällig am 14.09.2023 (b)(c)	€	10.180	€	10.111	0,80
3,425 % fällig am 14.09.2023 (b)(c)		1.250		1.242	0,10
3,426 % fällig am 14.09.2023 (b)(c)		1.850		1.838	0,14
3,427 % fällig am 14.09.2023 (b)(c)		9.030		8.969	0,71
				37.963	3,01
EUROPEAN STABILITY MECHANISM TREASURY BILLS					
3,337 % fällig am 07.09.2023 (b)(c)		2.180		2.166	0,17
3,347 % fällig am 07.09.2023 (b)(c)		1.520		1.511	0,12
				3.677	0,29
EUROPEAN UNION TREASURY BILLS					
3,168 % fällig am 04.08.2023 (b)(c)		900		898	0,07
3,172 % fällig am 04.08.2023 (b)(c)		1.800		1.795	0,14
3,173 % fällig am 04.08.2023 (b)(c)		4.650		4.637	0,37
3,174 % fällig am 04.08.2023 (b)(c)		650		648	0,05
3,179 % fällig am 04.08.2023 (b)(c)		2.900		2.892	0,23
3,326 % fällig am 08.09.2023 (b)(c)		2.260		2.246	0,18
3,638 % fällig am 08.12.2023 (b)(c)		680		669	0,05
3,654 % fällig am 08.12.2023 (b)(c)		2.690		2.648	0,21
3,655 % fällig am 08.12.2023 (b)(c)		760		748	0,06
3,658 % fällig am 08.12.2023 (b)(c)		1.560		1.536	0,12
3,663 % fällig am 08.12.2023 (b)(c)		3.850		3.790	0,30
				22.507	1,78
FRANCE TREASURY BILLS					
3,350 % fällig am 30.08.2023 (b)(c)		16.470		16.384	1,30
3,387 % fällig am 13.09.2023 (b)(c)		7.520		7.470	0,59
				23.854	1,89

BESCHREIBUNG		PAR (000S)		MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
GERMANY TREASURY BILLS					
3,322 % fällig am 18.10.2023 (b)(c)	€	23.400	€	23.167	1,84
JAPAN TREASURY BILLS					
(0,248) % fällig am 03.07.2023 (b)(c)	¥	7.182.400		45.549	3,61
(0,229) % fällig am 03.07.2023 (b)(c)		2.697.600		17.107	1,35
				62.656	4,96
Summe kurzfristige Instrumente				174.531	13,83
Summe Übertragbare Wertpapiere				**€ 1.389.763**	**110,11**
		AKTIEN			
INVESTMENTFONDS					
ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN					
PIMCO Funds: Global Investors Series plc - PIMCO European High Yield Bond Fund (d)		1.494.064		15.508	1,23
BÖRSENGEHANDELTE FONDS					
PIMCO ETFs plc - PIMCO Euro Short Maturity UCITS ETF (d)		1.123.300		108.537	8,60
Summe Investmentfonds				**€124.045**	**9,83**

PENSIONSGESCHÄFTE

Kontrahent	Kredit-zins	Abrechnungs-datum	Fälligkeits-datum	Kapital-betrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensions-geschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensions-geschäft[1]	% des Nettovermögens
COM	3,250 %	30.06.2023	03.07.2023	€ 122.400	Brandenburg 0,010 % fällig am 02.06.2025	€ (100.000)	€ 122.400	€ 122.433	9,70
					Nordrhein-Westfalen 0,250 % fällig am 13.03.2026	(32.863)			
FICC	2,400	30.06.2023	03.07.2023	$ 299	U.S. Treasury Notes 4,625 % fällig am 30.06.2025	(280)	274	274	0,02
Summe Pensionsgeschäfte						**€ (133.143)**	**€ 122.674**	**€ 122.707**	**9,72**

[1] Umfasst aufgelaufene Zinsen.

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

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

FUTURES

Beschreibung	Art	Ablauf-monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Euro-Bund 10-Year Bond September Futures	Long	09.2023	201	€ (255)	(0,02)
Euro-Schatz September Futures	Short	09.2023	3.522	2.964	0,23
U.S. Treasury 10-Year Note September Futures	Long	09.2023	1.092	(757)	(0,06)
U.S. Treasury 10-Year Ultra September Futures	Long	09.2023	802	(901)	(0,07)
United Kingdom Long Gilt September Futures	Short	09.2023	19	19	0,00
				€ 1.070	0,08

VERKAUFSOPTIONEN

OPTIONEN AUF BÖRSENGEHANDELTE TERMINKONTRAKTE

Beschreibung	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Anzahl der Kontrakte	Aufgeld	Markt-wert	% des Nettovermögens
Put - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note August Futures	$ 111,500	21.07.2023	81	€ (33)	€ (28)	0,00
Call - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note August Futures	115,500	21.07.2023	81	(26)	(3)	0,00
Put - CBOT U.S. Treasury 30-Year Bond August Futures	123,000	21.07.2023	15	(5)	(2)	0,00
Call - CBOT U.S. Treasury 30-Year Bond August Futures	131,000	21.07.2023	15	(7)	(3)	0,00
				€ (71)	€ (36)	0,00
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate					**€ 1.034**	**0,08**

ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)

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

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMMISSIONEN - SCHUTZVERKAUF[1]

Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag[2]	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
AT&T, Inc.	1,000 %	20.06.2024	$ 13.000	€ (99)	(0,01)
AT&T, Inc.	1,000	20.06.2026	2.400	(22)	0,00
AT&T, Inc.	1,000	20.06.2028	1.100	8	0,00
Ford Motor Credit Co. LLC	5,000	20.06.2025	200	5	0,00
General Electric Co.	1,000	20.06.2026	8.700	26	0,00
				€ (82)	(0,01)

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES - SCHUTZVERKAUF[1]

Index/Tranchen	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag[2]	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
CDX.HY-39 5-Year Index	5,000 %	20.12.2027	$ 16.335	€ 671	0,05
CDX.HY-40 5-Year Index	5,000	20.06.2028	120.900	3.114	0,25
CDX.IG-40 5-Year Index	1,000	20.06.2028	3.400	22	0,00
				€ 3.807	0,30

ZINSSWAPS

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits-datum	Nennbetrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Zahlung[3]	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	3,250 %	20.09.2053	£ 2.600	€ (213)	(0,02)
Erhalt[3]	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	3,750	20.09.2028	25.900	1.510	0,12
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,400	15.06.2032	¥ 8.530.000	688	0,05
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	0,000	04.08.2023	$ 220.700	2.789	0,22
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,270	04.11.2023	220.700	(3.966)	(0,31)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,868	05.05.2032	15.100	(1.757)	(0,14)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,040	25.05.2032	7.800	(797)	(0,06)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,068	11.05.2032	15.400	(1.572)	(0,12)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,153	18.05.2032	15.400	(1.456)	(0,12)
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,750	21.06.2053	39.900	1.875	0,15
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,000	21.06.2033	3.085	(92)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,300	06.03.2033	2.600	(56)	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,300	14.06.2033	9.700	(157)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,420	24.05.2033	7.600	(65)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,425	01.03.2033	40.200	(471)	(0,04)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,450	07.03.2033	5.000	(49)	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,500	22.06.2030	12.200	(100)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,500	21.06.2033	8.100	(5)	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,525	02.03.2030	1.800	(23)	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,750	21.06.2025	74.000	(1.249)	(0,10)
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,750	15.03.2030	46.000	1.233	0,10
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,800	10.03.2028	5.000	(38)	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	0,000	04.08.2023	220.700	(2.775)	(0,22)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	0,500	09.02.2024	€ 115.000	(2.290)	(0,18)
Erhalt[3]	6-Month EUR-EURIBOR	0,830	09.12.2052	26.700	1.184	0,09
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	1,520	07.07.2027	9.600	(617)	(0,05)
Erhalt[3]	6-Month EUR-EURIBOR	2,500	20.09.2053	41.200	(121)	(0,01)
Zahlung[3]	6-Month EUR-EURIBOR	3,000	20.09.2028	133.900	340	0,03
Zahlung[3]	6-Month EUR-EURIBOR	3,150	30.01.2025	667.700	(4.904)	(0,39)
Erhalt[3]	6-Month EUR-EURIBOR	3,500	20.09.2025	11.000	88	0,01
Erhalt	CPTFEMU	2,500	15.01.2025	68.100	492	0,04
					€ (12.574)	(0,99)
Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate					**€ (8.849)**	**(0,70)**

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

(2) Der maximal mögliche Betrag, den der Fonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

(3) Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft.

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

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

VERKAUFSOPTIONEN

ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag[1]	Aufgeld	Markt-wert	% des Nettovermögens
BOA	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,380 %	31.07.2023	2.700	€ (9)	€ (12)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,780	31.07.2023	2.700	(9)	(7)	0,00
	Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,070	10.07.2023	2.800	(17)	(7)	0,00
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,370	10.07.2023	2.800	(17)	(2)	0,00
	Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,060	14.07.2023	1.000	(7)	(4)	0,00
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,360	14.07.2023	1.000	(7)	(2)	0,00
BPS	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,200	06.07.2023	2.300	(7)	0	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,650	06.07.2023	2.300	(7)	(2)	0,00
	Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,000	03.07.2023	1.700	(11)	0	0,00
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,400	03.07.2023	1.700	(11)	0	0,00
BRC	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,260	26.07.2023	1.100	(3)	(2)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,660	26.07.2023	1.100	(3)	(5)	0,00
	Call - OTC 7-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,350	27.07.2023	1.300	(3)	(2)	0,00
	Put - OTC 7-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,850	27.07.2023	1.300	(3)	(4)	0,00
FAR	Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,000	03.07.2023	2.000	(13)	0	0,00
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,400	03.07.2023	2.000	(13)	0	0,00
	Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,100	31.08.2023	8.500	(58)	(11)	0,00
	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,800	31.08.2023	8.500	(58)	(79)	(0,02)
GLM	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,260	26.07.2023	2.300	(7)	(4)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,660	26.07.2023	2.300	(7)	(10)	0,00
	Call - OTC 7-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,350	27.07.2023	1.300	(3)	(2)	0,00
	Put - OTC 7-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,850	27.07.2023	1.300	(3)	(4)	0,00
JPM	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,300	10.07.2023	2.000	(7)	(1)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,750	10.07.2023	2.000	(7)	(1)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,250	20.07.2023	2.900	(9)	(4)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,650	20.07.2023	2.900	(9)	(11)	0,00
MYC	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,200	06.07.2023	2.300	(7)	0	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,650	06.07.2023	2.300	(7)	(2)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,300	10.07.2023	2.000	(6)	(1)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,750	10.07.2023	2.000	(6)	(1)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,270	24.07.2023	2.200	(7)	(4)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,670	24.07.2023	2.200	(7)	(9)	0,00
							€ (348)	€ (193)	(0,02)

OPTIONEN AUF WERTPAPIERE

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag[1]	Aufgeld	Markt-wert	% des Nettovermögens
JPM	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 4,000 % fällig am 01.07.2053	$ 93,281	06.07.2023	1.800	€ (7)	€ (2)	0,00

[1] Der Nennbetrag stellt die Anzahl der Kontrakte dar.

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMMISSIONEN - SCHUTZVERKAUF[1]

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag[2]	Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Markt-wert	% des Nettovermögens
GST	ADLER Real Estate AG	5,000 %	20.12.2026	€ 1.200	€ (6)	€ (265)	€ (271)	(0,02)
JPM	Banca Monte dei Paschi di Siena SpA	5,000	20.12.2023	4.600	0	36	36	0,00
					€ (6)	€ (229)	€ (235)	(0,02)

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

[2] Der maximal mögliche Betrag, den der Fonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung		Zu erhaltende Währung		Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2023	€	5.623	$	6.138	€ 8	€ (5)	€ 3	0,00
	07.2023	KRW	240.525		184	1	0	1	0,00
	08.2023	€	13.124	AUD	21.374	0	(95)	(95)	(0,01)
	09.2023	TWD	1.183	$	39	1	0	1	0,00
	09.2023	$	3.319	IDR	49.689.442	0	(17)	(17)	0,00
	09.2023		1.493	KRW	1.891.572	0	(47)	(47)	0,00
BPS	07.2023	€	284.621	$	311.765	1.184	(44)	1.140	0,09
	07.2023	KRW	36.599		28	0	0	0	0,00
	08.2023	CNH	729		106	5	0	5	0,00
	08.2023	£	488	€	567	0	0	0	0,00
	08.2023	KRW	2.395.712	$	1.827	6	0	6	0,00
	08.2023	TWD	592		19	0	0	0	0,00
	08.2023	$	299.733	€	273.170	0	(1.187)	(1.187)	(0,09)
	08.2023		1.496	INR	122.911	0	0	0	0,00
BRC	07.2023	¥	9.880.000	€	70.570	7.915	0	7.915	0,64
	07.2023	KRW	243.065	$	186	1	0	1	0,00
	08.2023	€	966	£	835	5	0	5	0,00
	08.2023	¥	88.300	€	602	39	0	39	0,00
CBK	07.2023	€	4.861	$	5.271	0	(30)	(30)	0,00
	08.2023	CNH	216		31	1	0	1	0,00
	08.2023	£	1.340	€	1.532	0	(27)	(27)	0,00
	08.2023	TWD	570	$	19	0	0	0	0,00
	09.2023	KRW	242.283		187	3	0	3	0,00
DUB	07.2023	€	5.342		5.733	0	(87)	(87)	(0,01)
	07.2023	$	11.784	BRL	63.851	1.328	0	1.328	0,11
	08.2023	€	3.246	NZD	5.650	0	(81)	(81)	(0,01)
	10.2023	$	119	ZAR	2.174	0	(5)	(5)	0,00
GLM	07.2023	BRL	64.053	$	13.266	0	(9)	(9)	0,00
	07.2023	KRW	95.417		73	0	0	0	0,00
	08.2023	€	6.209	NOK	71.805	0	(70)	(70)	(0,01)
	08.2023	KRW	1.145.553	$	871	0	0	0	0,00
	08.2023	$	2.306	INR	189.439	0	0	0	0,00
	09.2023		13.266	BRL	64.763	7	0	7	0,00
JPM	07.2023	DKK	997	€	134	0	0	0	0,00
	07.2023	€	134	DKK	996	0	0	0	0,00
	07.2023	$	15.387	€	14.269	165	0	165	0,01
	08.2023	DKK	996		134	0	0	0	0,00
	08.2023	€	2.760	£	2.368	0	(6)	(6)	0,00
	08.2023		1.928	¥	281.099	0	(138)	(138)	(0,01)
	08.2023	£	33.377	€	38.309	0	(510)	(510)	(0,04)
	08.2023	KRW	201.838	$	153	0	0	0	0,00
	09.2023	INR	10.511		128	0	0	0	0,00
	09.2023	KRW	672.307		517	4	0	4	0,00
	09.2023	$	1.384	IDR	20.816.293	0	(1)	(1)	0,00
	10.2023	MXN	19.151	$	1.091	0	(4)	(4)	0,00
	12.2023	$	1.571	INR	129.643	0	(1)	(1)	0,00
MBC	07.2023	€	2.676	$	2.930	10	0	10	0,00
	08.2023		2.583	£	2.222	1	0	1	0,00
	08.2023		10.885	¥	1.585.563	0	(784)	(784)	(0,06)
	09.2023	$	2.749	KRW	3.506.427	0	(70)	(70)	(0,01)
MYI	07.2023	€	4.383	$	4.796	13	0	13	0,00
	07.2023	IDR	13.098.728		876	2	0	2	0,00
	07.2023	$	11.788	€	11.030	225	0	225	0,02
	07.2023		872	IDR	13.098.728	2	0	2	0,00
	08.2023	£	1.180	€	1.352	0	(21)	(21)	0,00
	08.2023	TWD	637	$	21	1	0	1	0,00
	09.2023	INR	2.270		28	0	0	0	0,00
	09.2023	KRW	1.301.348		1.002	9	0	9	0,00
	09.2023	$	876	IDR	13.110.114	0	(5)	(5)	0,00
	09.2023		3.079	KRW	3.940.658	0	(69)	(69)	(0,01)
RBC	07.2023		7.500	MXN	144.318	822	0	822	0,06
	08.2023		1.216		21.068	2	0	2	0,00
SCX	08.2023	£	52.923	€	60.607	0	(945)	(945)	(0,07)
	08.2023	NZD	871		484	0	(4)	(4)	0,00
	09.2023	INR	6.574	$	80	0	0	0	0,00
	09.2023	KRW	239.131		185	3	0	3	0,00
	09.2023	TWD	988		32	1	0	1	0,00
	09.2023	$	2.050	IDR	30.486.750	0	(23)	(23)	0,00
SOG	07.2023		299.994	€	278.873	3.901	0	3.901	0,31
SSB	07.2023	KRW	177.793	$	136	1	0	1	0,00
	09.2023	$	8.202	BRL	41.580	293	0	293	0,02
	12.2023		160	INR	13.206	0	0	0	0,00
UAG	08.2023	NZD	4.599	€	2.556	0	(21)	(21)	0,00
						€ 15.959	€ (4.306)	€ 11.653	0,93

Summe Freiverkehrsfinanzderivate	**€ 11.223**	**0,89**
Summe Anlagen	**€ 1.639.890**	**129,93**
Sonstige Aktiva und Passiva	**€ (377.720)**	**(29,93)**
Nettovermögen	**€ 1.262.170**	**100,00**

ERLÄUTERUNGEN ZUR AUFSTELLUNG DES WERTPAPIERBESTANDS (Angaben in Tausend*):

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

^ Das Wertpapier ist in Verzug.

(a) Bei dem Wertpapier handelt es sich um ein Interest Only- („IO“) bzw. IO-Strip.

(b) Nullkuponwertpapier.

(c) Der Kupon stellt eine Rendite bis zur Endfälligkeit dar.

(d) Mit dem Fonds verbunden.

(e) Bedingt wandelbares Wertpapier.

(f) Eingeschränkte Wertpapiere (31. Dezember 2022: 0,06 %):

Emittentenbeschreibung	Kupon	Fälligkeitsdatum	Kaufdatum	Kosten	Marktwert	% des Nettovermögens
Corestate Capital Holding S.A.	15,000 %	31.07.2023	06.12.2022	€ 700	€ 707	0,06
Deutsche Bank AG	2,129	24.11.2026	11.01.2023	2.350	2.285	0,18
Deutsche Bank AG	3,035	28.05.2032	29.07.2021	173	144	0,01
				€ 3.223	€ 3.136	0,25

(g) Wertpapier mit einem gesamten beizulegenden Zeitwert von 9.079 EUR (31. Dezember 2022: null EUR) wurden zum 30. Juni 2023 gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen als Sicherheit für Pensionsgeschäfte verpfändet.

Barmittel in Höhe von 247 EUR (31. Dezember 2022: null EUR) wurden zum 30. Juni 2023 gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen als Sicherheit für Pensionsgeschäfte geliefert.

Barmittel in Höhe von 44.941 EUR (31. Dezember 2022: 41.642 EUR) wurden zum 30. Juni 2023 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Barmittel in Höhe von 2.241 EUR (31. Dezember 2022: 5.462 EUR) wurden zum 30. Juni 2023 gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. als Sicherheit für Finanzderivate verpfändet.

Beizulegender Zeitwert[1]

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 30. Juni 2023 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie[2]	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	€ 0	€ 1.388.755	€ 1.008	€ 1.389.763
Investmentfonds	15.508	108.537	0	124.045
Pensionsgeschäfte	0	122.674	0	122.674
Finanzderivate[3]	2.728	680	0	3.408
Summen	**€ 18.236**	**€ 1.620.646**	**€ 1.008**	**€ 1.639.890**

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

Kategorie[2]	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	€ 0	€ 1.098.581	€ 1.860	€ 1.100.441
Investmentfonds	134.815	0	0	134.815
Pensionsgeschäfte	0	120.458	0	120.458
Finanzderivate[3]	3.623	(5.077)	0	(1.454)
Summen	**€ 138.438**	**€ 1.213.962**	**€ 1.860**	**€ 1.354.260**

(1) Weitere Informationen finden Sie in den Erläuterungen in Erläuterung 3.

(2) Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung des Wertpapierbestands.

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

Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2023:

Kontrahent	Kredit-zins	Abrechnungs-datum	Fälligkeits-datum	Kredit-betrag	Verbindlichkeiten aus umgekehrten Pensions-geschäften	% des Nettovermögens
MYI	1,500 %	10.05.2023	TBD[1]	€ (3.636)	€ (3.643)	(0,29)
	1,500	13.06.2023	TBD[1]	(5.209)	(5.213)	(0,41)
Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte					**€ (8.856)**	**(0,70)**

(1) Umgekehrtes Pensionsgeschäft mit offener Laufzeit.

Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC-Finanzderivate und -Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2023 und 31. Dezember 2022:

	Zum 30. Jun. 2023			Zum 31. Dez. 2022		
Kontrahent	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-Engagement[1]	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-Engagement[1]
BOA	€ (188)	€ 247	€ 59	€ 149	€ (272)	€ (123)
BPS	(38)	60	22	275	(290)	(15)
BRC	7.947	(7.727)	220	175	0	175
CBK	(53)	0	(53)	(16)	0	(16)
DUB	1.155	(1.237)	(82)	k. A.	k. A.	k. A.
FAR	(90)	0	(90)	k. A.	k. A.	k. A.
GLM	(92)	18	(74)	(3.563)	3.382	(181)
GST	(271)	321	50	(289)	328	39
JPM	(474)	321	(153)	(2.314)	1.752	(562)
MBC	(843)	742	(101)	3.869	(3.429)	440
MYC	(17)	0	(17)	k. A.	k. A.	k. A.
MYI	157	(247)	(90)	(128)	0	(128)
RBC	824	(910)	(86)	(168)	0	(168)
RYL	k. A.	k. A.	k. A.	83	0	83
SCX	(968)	532	(436)	(42)	0	(42)
SOG	3.901	(2.878)	1.023	k. A.	k. A.	k. A.
SSB	294	(257)	37	428	(272)	156
UAG	(21)	(238)	(259)	65	0	65

[1] Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären.

Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung des Wertpapierbestands zum 30. Juni 2023:

	30. Jun. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	80,93	60,94
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	29,18	19,96
Sonstige übertragbare Wertpapiere	k. A.	0,44
Investmentfonds	9,83	9,96
Pensionsgeschäfte	9,72	8,90
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	0,08	0,20
Zentral abgerechnete Finanzderivate	(0,70)	(0,20)
Freiverkehrsfinanzderivate	0,89	(0,11)
Umgekehrte Pensionsgeschäfte	(0,70)	k. A.

Das Anlageportfolio des Fonds konzentriert sich zum 30. Juni 2023 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	30. Jun. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
Kreditbeteiligungen und -abtretung	1,06	2,26
Unternehmensanleihen und Wechsel	26,02	43,78
Wandelanleihen & Wechsel	0,09	0,11
US-Regierungsbehörden	34,32	6,78
Non-Agency-MBS	18,68	3,46
Forderungsbesicherte Wertpapiere	15,81	11,18
Staatsemissionen	0,30	1,15
Kurzfristige Instrumente	13,83	12,62
Investmentfonds	9,83	9,96
Pensionsgeschäfte	9,72	8,90
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	0,08	0,20
Verkaufsoptionen		
Optionen auf börsengehandelte Terminkontrakte	0,00	k. A.
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	(0,01)	(0,02)
Credit Default Swaps auf Kreditindizes— Schutzverkauf	0,30	0,16
Zinsswaps	(0,99)	(0,34)
Freiverkehrsfinanzderivate		
Verkaufsoptionen		
Credit Default Swaptions auf Kreditindizes	k. A.	0,00
Zinsswapoptionen	(0,02)	(0,24)
Optionen auf Wertpapiere	0,00	k. A.
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	(0,02)	(0,02)
Devisenterminkontrakte	0,93	0,15
Sonstige Aktiva und Passiva	(29,93)	(0,09)
Nettovermögen	100,00	100,00

Aufstellung des Wertpapierbestands des Euro Long Average Duration Fund

BESCHREIBUNG		PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
BANKEN UND FINANZEN				
AMCO - Asset Management Co. SpA				
4,625 % fällig am 06.02.2027	€	400	€ 398	0,09
AXA Bank Europe SCF				
3,000 % fällig am 03.11.2026		900	881	0,20
Banco BPM SpA				
3,750 % fällig am 27.06.2028		300	299	0,07
Bank of Montreal				
1,000 % fällig am 05.04.2026		800	740	0,16
Barclays PLC				
3,125 % fällig am 17.01.2024	£	1.000	1.144	0,25
Coventry Building Society				
2,625 % fällig am 07.12.2026	€	100	96	0,02
Credit Suisse Schweiz AG				
3,390 % fällig am 05.12.2025		1.100	1.077	0,24
Europäische Union				
0,700 % fällig am 06.07.2051		1.000	557	0,12
Federation des Caisses Desjardins du Quebec				
2,000 % fällig am 31.08.2026		900	852	0,19
3,250 % fällig am 18.04.2028		1.600	1.573	0,35
Hamburg Commercial Bank AG				
4,875 % fällig am 17.03.2025		150	150	0,03
Jyske Realkredit A/S				
1,000 % fällig am 01.10.2050	DKK	12	1	0,00
1,000 % fällig am 01.10.2053		0	0	0,00
1,500 % fällig am 01.10.2050		3	0	0,00
2,000 % fällig am 01.10.2050		16	2	0,00
Liberty Mutual Group, Inc.				
3,625 % fällig am 23.05.2059	€	1.400	1.333	0,30
National Bank of Canada				
3,500 % fällig am 25.04.2028		100	100	0,02
Nordea Kredit Realkreditaktieselskab				
1,000 % fällig am 01.10.2050	DKK	0	0	0,00
1,500 % fällig am 01.10.2050		0	0	0,00
2,000 % fällig am 01.10.2047		0	0	0,00
2,000 % fällig am 01.10.2050		19	2	0,00
Nykredit Realkredit A/S				
1,000 % fällig am 01.10.2050		0	0	0,00
1,000 % fällig am 01.10.2053		10	1	0,00
1,500 % fällig am 01.10.2047		1	0	0,00
1,500 % fällig am 01.10.2050		0	0	0,00
1,500 % fällig am 01.10.2053		0	0	0,00
2,000 % fällig am 01.10.2047		0	0	0,00
2,000 % fällig am 01.10.2050		22	2	0,00
2,000 % fällig am 01.10.2053		0	0	0,00
3,000 % fällig am 01.10.2053		0	0	0,00
3,500 % fällig am 01.10.2053		0	0	0,00
5,000 % fällig am 01.10.2053		10	1	0,00
Permanent TSB Group Holdings PLC				
5,250 % fällig am 30.06.2025	€	100	99	0,02
Realkredit Danmark A/S				
1,000 % fällig am 01.10.2050	DKK	0	0	0,00
1,500 % fällig am 01.10.2053		0	0	0,00
2,000 % fällig am 01.10.2047		0	0	0,00
3,000 % fällig am 01.10.2053		0	0	0,00
SLM Student Loan Trust				
4,076 % fällig am 15.12.2033	€	435	402	0,09
Sumitomo Mitsui Banking Corp.				
0,267 % fällig am 18.06.2026		900	805	0,18
3,602 % fällig am 16.02.2026		100	99	0,02
Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd.				
3,629 % fällig am 06.04.2026		1.800	1.778	0,40
Toronto-Dominion Bank				
3,879 % fällig am 13.03.2026		1.200	1.198	0,27
UniCredit Bank Czech Republic & Slovakia A/S				
3,625 % fällig am 15.02.2026		100	98	0,02
UniCredit SpA				
3,375 % fällig am 31.01.2027		400	395	0,09
			14.083	3,13
INDUSTRIEWERTE				
Nokia Oyj				
4,375 % fällig am 21.08.2031		100	99	0,02
SK Hynix, Inc.				
1,000 % fällig am 19.01.2024	$	200	€ 178	0,04
			277	0,06
Summe Unternehmensanleihen und Wechsel			14.360	3,19
US-REGIERUNGSBEHÖRDEN				
Fannie Mae				
4,560 % fällig am 01.08.2036		1	1	0,00
5,036 % fällig am 25.07.2037		5	4	0,00
Uniform Mortgage-Backed Security				
3,500 % fällig am 01.07.2048		469	397	0,09
Uniform Mortgage-Backed Security, TBA				
4,000 % fällig am 01.08.2053		18.150	15.627	3,47
4,500 % fällig am 01.08.2053		16.100	14.195	3,15
5,000 % fällig am 01.08.2053		7.400	6.651	1,48
			36.875	8,19
US-SCHATZOBLIGATIONEN				
U.S. Treasury Inflation Protected Securities (d)				
0,125 % fällig am 15.07.2024		5.110	4.544	1,01
0,125 % fällig am 15.01.2032		2.517	2.032	0,45
0,500 % fällig am 15.04.2024		722	646	0,14
0,500 % fällig am 15.01.2028		1.599	1.371	0,31
0,625 % fällig am 15.01.2024		8.711	7.849	1,74
1,625 % fällig am 15.10.2027		11.879	10.731	2,39
			27.173	6,04
NON-AGENCY-MBS				
Alba PLC				
3,686 % fällig am 15.12.2038	€	195	186	0,04
Atlas Funding PLC				
5,937 % fällig am 20.01.2061	£	792	924	0,21
Avon Finance PLC				
5,809 % fällig am 20.09.2048		479	558	0,12
Barley Hill PLC				
5,824 % fällig am 27.08.2058		101	118	0,03
Bear Stearns Adjustable Rate Mortgage Trust				
4,635 % fällig am 25.07.2033	$	3	3	0,00
Brants Bridge PLC				
0,000 % fällig am 14.06.2066 (a)	£	2.000	2.319	0,52
Canada Square Funding PLC				
5,316 % fällig am 17.01.2059		1.954	2.264	0,50
5,682 % fällig am 17.06.2058		234	271	0,06
5,852 % fällig am 17.06.2058		315	365	0,08
Charter Mortgage Funding PLC				
5,327 % fällig am 16.01.2057		65	76	0,02
Credit Suisse First Boston Mortgage-Backed Pass-Through Certificates				
4,260 % fällig am 25.07.2033	$	5	4	0,00
Dilosk RMBS DAC				
4,070 % fällig am 20.07.2061	€	400	400	0,09
4,133 % fällig am 20.02.2060		0	0	0,00
Domi BV				
4,027 % fällig am 15.04.2054		810	807	0,18
4,203 % fällig am 15.11.2052		823	823	0,18
Dutch Property Finance BV				
4,168 % fällig am 28.04.2064		197	198	0,04
4,492 % fällig am 28.04.2050		184	181	0,04
Eurohome UK Mortgages PLC				
5,137 % fällig am 15.06.2044	£	121	136	0,03
Great Hall Mortgages PLC				
3,677 % fällig am 18.03.2039	€	36	36	0,01
5,644 % fällig am 18.06.2039	$	15	14	0,00
Jubilee Place BV				
4,177 % fällig am 17.10.2057	€	89	89	0,02
Landmark Mortgage Securities PLC				
5,222 % fällig am 17.06.2039	£	171	192	0,04
London Wall Mortgage Capital PLC				
5,452 % fällig am 15.05.2051		669	775	0,17
Ludgate Funding PLC				
4,590 % fällig am 01.01.2061		75	83	0,02
5,068 % fällig am 01.12.2060		192	213	0,05
Newgate Funding PLC				
4,126 % fällig am 15.12.2050	€	675	650	0,15
Pierpont BTL PLC				
0,000 % fällig am 21.09.2054	£	300	€ 349	0,08
Precise Mortgage Funding PLC				
6,065 % fällig am 12.12.2055		168	196	0,04
Primrose Residential DAC				
4,189 % fällig am 24.03.2061	€	317	315	0,07
4,439 % fällig am 24.10.2061		519	514	0,11
Ripon Mortgages PLC				
5,491 % fällig am 28.08.2056	£	0	0	0,00
RMAC Securities PLC				
5,134 % fällig am 12.06.2044		190	212	0,05
Shamrock Residential DAC				
4,289 % fällig am 24.12.2059	€	144	143	0,03
Stratton Mortgage Funding PLC				
5,765 % fällig am 12.03.2052	£	189	219	0,05
5,792 % fällig am 25.09.2051		274	318	0,07
Structured Asset Mortgage Investments Trust				
5,646 % fällig am 19.07.2035	$	11	10	0,00
Thornburg Mortgage Securities Trust				
5,790 % fällig am 25.09.2043		18	15	0,00
Towd Point Mortgage Funding PLC				
6,097 % fällig am 20.05.2045	£	711	826	0,18
Tower Bridge Funding PLC				
5,629 % fällig am 20.12.2063		174	201	0,05
Tudor Rose Mortgages				
5,509 % fällig am 20.06.2048		209	242	0,05
Twin Bridges PLC				
5,635 % fällig am 01.12.2055		640	739	0,17
			15.984	3,55
FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE				
Accunia European CLO DAC				
4,107 % fällig am 15.10.2030	€	102	101	0,02
4,127 % fällig am 15.07.2030		497	490	0,11
Ares European CLO DAC				
3,837 % fällig am 15.10.2030		199	195	0,04
Bain Capital Euro CLO DAC				
3,940 % fällig am 20.01.2032		199	194	0,04
BBVA Consumer Auto				
0,270 % fällig am 20.07.2031		53	51	0,01
Black Diamond CLO DAC				
4,060 % fällig am 20.01.2032		418	413	0,09
BlueMountain Fuji EUR CLO DAC				
1,050 % fällig am 15.01.2031		99	92	0,02
4,087 % fällig am 15.01.2033		400	390	0,09
BNPP AM Euro CLO DAC				
3,827 % fällig am 15.10.2031		246	241	0,05
Bumper BE NV/S.A.				
4,139 % fällig am 23.10.2031		699	701	0,16
Cairn CLO DAC				
3,957 % fällig am 15.10.2031		600	588	0,13
4,051 % fällig am 25.07.2029		157	157	0,03
Carlyle Global Market Strategies Euro CLO Ltd.				
4,073 % fällig am 15.11.2031		300	294	0,07
Citizen Irish Auto Receivables Trust DAC				
4,148 % fällig am 15.12.2029		830	831	0,18
Ginkgo Sales Finance				
4,113 % fällig am 25.11.2049		272	272	0,06
Harvest CLO DAC				
3,937 % fällig am 15.07.2031		300	293	0,07
Jubilee CLO DAC				
4,047 % fällig am 15.01.2030		1.196	1.186	0,26
Laurelin DAC				
3,920 % fällig am 20.10.2031		400	393	0,09
Madison Park Euro Funding DAC				
3,927 % fällig am 15.01.2032		400	392	0,09
Man GLG Euro CLO DAC				
3,857 % fällig am 15.10.2030		293	288	0,06
4,047 % fällig am 15.01.2030		440	434	0,10
NovaStar Mortgage Funding Trust				
5,855 % fällig am 25.01.2036	$	255	231	0,05
Oak Hill European Credit Partners DAC				
3,930 % fällig am 20.01.2032	€	2.909	2.859	0,64
Palmer Square European Loan Funding DAC				
5,025 % fällig am 12.04.2032		286	288	0,06

BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
Revocar UG			
4,032 % fällig am 21.04.2036	€ 294	€ 294	0,07
Silver Arrow Athlon NL BV			
4,139 % fällig am 26.04.2031	810	812	0,18
SLM Student Loan Trust			
4,076 % fällig am 15.12.2033	129	119	0,03
Tikehau CLO DAC			
4,144 % fällig am 04.08.2034	400	391	0,09
Toro European CLO DAC			
4,133 % fällig am 15.02.2034	400	389	0,09
Voya Euro CLO DAC			
3,927 % fällig am 15.10.2030	383	379	0,08
		13.758	3,06
STAATSEMISSIONEN			
Action Logement Services			
3,625 % fällig am 25.05.2043	2.500	2.468	0,55
Austria Government International Bond			
0,850 % fällig am 30.06.2120	110	46	0,01
Belgium Government International Bond			
1,400 % fällig am 22.06.2053	6.800	4.342	0,97
Cassa Depositi e Prestiti SpA			
5,750 % fällig am 05.05.2026	$ 400	362	0,08
Europäische Union			
3,000 % fällig am 04.03.2053	€ 300	285	0,06

BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
France Government International Bond			
0,500 % fällig am 25.05.2072	€ 8.950	€ 3.526	0,78
0,750 % fällig am 25.05.2052	28.100	15.324	3,41
0,750 % fällig am 25.05.2053	12.100	6.447	1,43
1,250 % fällig am 25.05.2038	7.700	5.979	1,33
1,500 % fällig am 25.05.2050	11.300	7.856	1,75
1,750 % fällig am 25.05.2066	7.670	5.252	1,17
2,000 % fällig am 25.05.2048	8.200	6.486	1,44
2,500 % fällig am 25.05.2043	20.100	17.896	3,98
3,000 % fällig am 25.05.2054	18.900	17.876	3,97
3,250 % fällig am 25.05.2045	24.500	24.585	5,46
4,000 % fällig am 25.10.2038	34.500	38.063	8,46
4,000 % fällig am 25.04.2055	9.700	11.104	2,47
4,000 % fällig am 25.04.2060	20.850	24.218	5,38
4,500 % fällig am 25.04.2041	50.150	58.976	13,11
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro			
0,400 % fällig am 15.05.2030 (d)	1.186	1.085	0,24
1,300 % fällig am 15.05.2028 (d)	4.405	4.322	0,96
Netherlands Government International Bond			
0,000 % fällig am 15.01.2038 (b)	13.800	9.273	2,06
0,000 % fällig am 15.01.2052 (b)	19.500	9.512	2,11
2,750 % fällig am 15.01.2047	17.350	17.700	3,93
4,000 % fällig am 15.01.2037	4.800	5.456	1,21
Region Wallonne Belgium			
3,500 % fällig am 15.03.2043	1.400	1.358	0,30
Bundesrepublik Deutschland			
1,250 % fällig am 15.08.2048	3.500	2.782	0,62
2,500 % fällig am 04.07.2044	1.500	1.514	0,34

BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
2,500 % fällig am 15.08.2046	€ 4.400	€ 4.486	1,00
4,750 % fällig am 04.07.2040	8.900	11.656	2,59
Slovenia Government International Bond			
0,000 % fällig am 12.02.2031 (b)	3.500	2.744	0,61
1,500 % fällig am 25.03.2035	9.500	7.676	1,71
3,625 % fällig am 11.03.2033	100	104	0,02
Societe Du Grand Paris EPIC			
3,500 % fällig am 25.05.2043	1.800	1.754	0,39
		332.513	73,90
KURZFRISTIGE INSTRUMENTE			
EUROPEAN UNION TREASURY BILLS			
European Union Treasury Bills			
3,667 % fällig am 08.12.2023 (b)(c)	1.300	1.280	0,29
Summe kurzfristige Instrumente		1.280	0,29
Summe Übertragbare Wertpapiere		**€ 441.943**	**98,22**
	AKTIEN		
INVESTMENTFONDS			
BÖRSENGEHANDELTE FONDS			
PIMCO ETFs plc - PIMCO Euro Short Maturity UCITS ETF (e)	115.500	11.160	2,48
Summe Investmentfonds		**€ 11.160**	**2,48**

PENSIONSGESCHÄFTE

Kontrahent	Kredit-zins	Abrechnungs-datum	Fälligkeits-datum	Kapital-betrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensions-geschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensions-geschäft[1]	% des Nettovermögens
COM	3,250 %	30.06.2023	03.07.2023	€ 6.700	Land Berlin 6,250 % fällig am 28.02.2028	€ (6.030)	€ 6.700	€ 6.702	1,49
FICC	2,400	30.06.2023	03.07.2023	$ 691	U.S. Treasury Notes 4,625 % fällig am 30.06.2025	(646)	633	633	0,14
Summe Pensionsgeschäfte						**€ (6.676)**	**€ 7.333**	**€ 7.335**	**1,63**

[1] Umfasst aufgelaufene Zinsen.

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

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

FUTURES

Beschreibung	Art	Ablauf-monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Euro-Bobl September Futures	Short	09.2023	113	€ 54	0,01
Euro-BTP Italy Government Bond September Futures	Short	09.2023	23	2	0,00
Euro-Bund 10-Year Bond September Futures	Long	09.2023	64	(33)	(0,01)
Euro-Buxl 30-Year Bond September Futures	Long	09.2023	846	488	0,11
Euro-OAT France Government 10-Year Bond September Futures	Short	09.2023	85	30	0,01
Euro-Schatz September Futures	Short	09.2023	201	71	0,02
U.S. Treasury 2-Year Note September Futures	Short	09.2023	118	61	0,01
U.S. Treasury 5-Year Note September Futures	Short	09.2023	440	271	0,06
U.S. Treasury 10-Year Note September Futures	Long	09.2023	241	(161)	(0,04)
U.S. Treasury 10-Year Ultra September Futures	Short	09.2023	8	(2)	0,00
U.S. Treasury 30-Year Bond September Futures	Short	09.2023	80	(12)	0,00
U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond September Futures	Short	09.2023	48	(43)	(0,01)
				€ 726	0,16

VERKAUFSOPTIONEN

OPTIONEN AUF BÖRSENGEHANDELTE TERMINKONTRAKTE

Beschreibung	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Anzahl der Kontrakte	Aufgeld	Markt-wert	% des Nettovermögens
Put - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note August Futures	$ 113,000	21.07.2023	18	€ (12)	€ (18)	0,00
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate					**€ 708**	**0,16**

ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)

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

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMMISSIONEN - SCHUTZVERKAUF[1]

Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag[2]	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
British Telecommunications PLC	1,000 %	20.12.2028	€ 100	€ 1	0,00

ZINSSWAPS

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Erhalt[3]	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	3,250 %	20.09.2053	£ 110	€ 8	0,00
Zahlung[3]	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	4,000	20.09.2025	130	(3)	0,00
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,000	16.06.2029	¥ 147.000	(10)	0,00
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,050	15.12.2031	1.320.000	(57)	(0,01)
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,435	20.06.2029	103.000	(5)	0,00
Zahlung[3]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,880	25.01.2052	$ 800	(206)	(0,05)
Erhalt[3]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,865	13.02.2054	1.000	6	0,00
Zahlung[3]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,085	13.02.2034	1.100	(11)	0,00
Erhalt[3]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,250	20.12.2053	2.600	(9)	0,00
Zahlung[3]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,500	20.12.2033	3.300	(8)	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,880	25.07.2023	800	(3)	0,00
Erhalt[3]	6-Month EUR-EURIBOR	2,500	20.09.2053	€ 21.300	(65)	(0,02)
Zahlung[3]	6-Month EUR-EURIBOR	2,750	20.09.2043	8.300	101	0,02
Erhalt[3]	6-Month EUR-EURIBOR	3,000	20.09.2028	100	0	0,00
Zahlung[3]	6-Month EUR-EURIBOR	3,000	20.09.2033	4.800	(11)	0,00
Zahlung[3]	6-Month EUR-EURIBOR	3,000	20.09.2038	34.500	77	0,01
Erhalt[3]	6-Month EUR-EURIBOR	3,500	20.09.2025	34.800	139	0,03
Erhalt	CPTFEMU	3,340	15.08.2027	4.500	(12)	0,00
					€ (69)	(0,02)
Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate					**€ (68)**	**(0,02)**

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

(2) Der maximal mögliche Betrag, den der Fonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

(3) Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft.

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

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

VERKAUFSOPTIONEN

ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag[1]	Aufgeld	Markt-wert	% des Nettovermögens
BOA	Call - OTC 2-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	4,420 %	21.09.2023	7.000	€ (37)	€ (27)	(0,01)
BPS	Call - OTC 2-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,750	12.09.2023	7.100	(19)	(8)	0,00
							€ (56)	€ (35)	(0,01)

(1) Der Nennbetrag stellt die Anzahl der Kontrakte dar.

DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung		Zu erhaltende Währung		Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2023	€	1.522	DKK	11.333	€ 0	€ 0	€ 0	0,00
	08.2023	£	100	€	114	0	(2)	(2)	0,00
	08.2023	$	20	CNY	140	0	(1)	(1)	0,00
BPS	08.2023	CNH	1.127	$	164	8	0	8	0,00
	08.2023	€	144	£	123	0	(1)	(1)	0,00
	08.2023		230	$	248	0	(4)	(4)	0,00
	08.2023	£	2.417	€	2.810	0	(1)	(1)	0,00
	08.2023	$	18	CNH	127	0	(1)	(1)	0,00
	08.2023		24	CNY	165	0	(1)	(1)	0,00
	08.2023		399	€	364	0	(1)	(1)	0,00
BRC	08.2023	¥	13.200		90	6	0	6	0,00
	08.2023	$	1.219		1.122	7	0	7	0,00
	09.2023	ILS	52	$	15	0	0	0	0,00
CBK	08.2023	$	984	€	899	0	(1)	(1)	0,00
JPM	07.2023	DKK	11.425		1.534	0	0	0	0,00
	08.2023	€	1.252	£	1.091	16	0	16	0,00
	08.2023		1.167	¥	180.078	0	(20)	(20)	(0,01)
	08.2023		794	$	865	1	(4)	(3)	0,00
	08.2023	£	1.549	€	1.777	0	(24)	(24)	(0,01)
	08.2023	$	15	CNH	102	0	(1)	(1)	0,00
	08.2023		25	CNY	174	0	(1)	(1)	0,00
	08.2023		10.655	€	9.734	1	(13)	(12)	0,00
	09.2023	ILS	50	$	14	1	0	1	0,00
MBC	08.2023	€	1.502	¥	218.734	0	(109)	(109)	(0,02)
	08.2023	$	7.231	€	6.553	0	(61)	(61)	(0,01)
MYI	08.2023	€	943	¥	148.200	1	0	1	0,00
	08.2023	£	86	€	99	0	(2)	(2)	0,00
	08.2023	$	3.830		3.487	0	(16)	(16)	0,00
RYL	08.2023	£	296		340	0	(4)	(4)	0,00
	08.2023	¥	88.100		596	36	0	36	0,01
	08.2023	$	600		546	0	(2)	(2)	0,00
SCX	08.2023	€	122	£	105	0	0	0	0,00
	08.2023	£	3.391	€	3.898	0	(46)	(46)	(0,01)
	08.2023	$	68	CNY	463	0	(3)	(3)	0,00
UAG	09.2023	ILS	43	$	12	0	0	0	0,00
						€ 77	€ (319)	€ (242)	(0,05)

Summe Freiverkehrsfinanzderivate	**€ (277)**	**(0,06)**
Summe Anlagen	**€ 460.799**	**102,41**
Sonstige Aktiva und Passiva	**€ (10.834)**	**(2,41)**
Nettovermögen	**€ 449.965**	**100,00**

ERLÄUTERUNGEN ZUR AUFSTELLUNG DES WERTPAPIERBESTANDS (Angaben in Tausend*):

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

(a) **Wertpapier per Emissionstermin.**

(b) **Nullkuponwertpapier.**

(c) **Der Kupon stellt eine Rendite bis zur Endfälligkeit dar.**

(d) **Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.**

(e) **Mit dem Fonds verbunden.**

Barmittel in Höhe von 6.017 EUR (31. Dezember 2022: 4.192 EUR) wurden zum 30. Juni 2023 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Barmittel in Höhe von null EUR (31. Dezember 2022: 190 EUR) wurden zum 30. Juni 2023 gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. als Sicherheit für Finanzderivate verpfändet.

Beizulegender Zeitwert[1]

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 30. Juni 2023 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie[2]	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	€ 0	€ 441.939	€ 4	€ 441.943
Investmentfonds	97	11.063	0	11.160
Pensionsgeschäfte	0	7.333	0	7.333
Finanzderivate[3]	612	(249)	0	363
Summen	**€ 709**	**€ 460.086**	**€ 4**	**€ 460.799**

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

Kategorie[2]	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	€ 0	€ 103.959	€ 0	€ 103.959
Investmentfonds	4.940	0	0	4.940
Pensionsgeschäfte	0	1.500	0	1.500
Finanzderivate[3]	(7.079)	(7.962)	0	(15.041)
Summen	**€ (2.139)**	**€ 97.497**	**€ 0**	**€ 95.358**

(1) Weitere Informationen finden Sie in den Erläuterungen in Erläuterung 3.

(2) Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung des Wertpapierbestands.

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

Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC-Finanzderivate und -Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2023 und 31. Dezember 2022:

	Zum 30. Jun. 2023			Zum 31. Dez. 2022		
Kontrahent	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-engagement[1]	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-Engagement[1]
BOA	€ (30)	€ 0	€ (30)	€ (20)	€ 0	€ (20)
BPS	(9)	0	(9)	(57)	190	133
BRC	13	0	13	(84)	0	(84)
CBK	(1)	0	(1)	(44)	0	(44)
GLM	k. A.	k. A.	k. A.	(46)	0	(46)
GST	k. A.	k. A.	k. A.	(68)	0	(68)
JPM	(44)	0	(44)	(85)	0	(85)
MBC	(170)	0	(170)	3	0	3
MYC	k. A.	k. A.	k. A.	4	0	4
MYI	(17)	0	(17)	33	0	33
RBC	k. A.	k. A.	k. A.	27	0	27
RYL	30	0	30	(3)	0	(3)
SCX	(49)	0	(49)	(8)	0	(8)
SSB	k. A.	k. A.	k. A.	167	0	167
UAG	k. A.	k. A.	k. A.	5	0	5

(1) Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären.

Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung des Wertpapierbestands zum 30. Juni 2023:

	30. Jun. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	91,35	87,44
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	6,87	7,03
Investmentfonds	2,48	4,49
Pensionsgeschäfte	1,63	1,36
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	0,16	(6,40)
Zentral abgerechnete Finanzderivate	(0,02)	(7,11)
Freiverkehrsfinanzderivate	(0,06)	(0,16)

Das Anlageportfolio des Fonds konzentriert sich zum 30. Juni 2023 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	30. Jun. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
Unternehmensanleihen und Wechsel	3,19	7,89
US-Regierungsbehörden	8,19	5,28
US-Schatzobligationen	6,04	3,51
Non-Agency-MBS	3,55	12,44
Forderungsbesicherte Wertpapiere	3,06	10,28
Staatsemissionen	73,90	53,89
Kurzfristige Instrumente	0,29	1,18
Investmentfonds	2,48	4,49
Pensionsgeschäfte	1,63	1,36
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	0,16	(6,40)
Verkaufsoptionen		
Optionen auf börsengehandelte Terminkontrakte	0,00	k. A.
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	0,00	0,00
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzkauf	k. A.	(0,09)
Zinsswaps	(0,02)	(7,02)
Freiverkehrsfinanzderivate		
Optionskauf		
Zinsswapoptionen	k. A.	0,33

Anlagen zum Marktwert	30. Jun. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
Verkaufsoptionen		
Devisenoptionen	k. A.	(0,04)
Zinsswapoptionen	(0,01)	(0,74)
Devisenterminkontrakte	(0,05)	0,29
Sonstige Aktiva und Passiva	(2,41)	13,35
Nettovermögen	100,00	100,00

Aufstellung des Wertpapierbestands des Euro Short-Term Fund

BESCHREIBUNG		PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
BANKEN UND FINANZEN				
AMCO - Asset Management Co. SpA				
1,500 % fällig am 17.07.2023	€	1.630	€ 1.629	0,76
American Tower Corp.				
1,375 % fällig am 04.04.2025		1.100	1.043	0,49
Australia & New Zealand Banking Group Ltd.				
0,250 % fällig am 17.03.2025		1.500	1.410	0,66
4,675 % fällig am 15.06.2026	$	500	453	0,21
AyT Cedulas Cajas Fondo de Titulizacion de Activos				
3,750 % fällig am 30.06.2025	€	1.100	1.090	0,51
Banca Monte dei Paschi di Siena SpA				
2,875 % fällig am 16.07.2024		2.500	2.459	1,15
Banco de Sabadell S.A.				
1,625 % fällig am 07.03.2024		1.300	1.278	0,60
Banco Santander S.A.				
4,133 % fällig am 21.11.2024		200	200	0,09
Bank of America Corp.				
4,412 % fällig am 24.08.2025		2.100	2.108	0,99
Bank of Ireland Group PLC				
0,750 % fällig am 08.07.2024		900	900	0,42
Bank of Nova Scotia				
3,704 % fällig am 02.05.2025		900	901	0,42
Banque Federative du Credit Mutuel S.A.				
5,041 % fällig am 26.01.2025	£	1.600	1.854	0,87
Barclays PLC				
3,125 % fällig am 17.01.2024		500	572	0,27
BNG Bank NV				
0,050 % fällig am 11.07.2023	€	1.000	999	0,47
BNP Paribas S.A.				
0,500 % fällig am 15.07.2025		1.200	1.152	0,54
BNZ International Funding Ltd.				
0,625 % fällig am 03.07.2025		3.400	3.178	1,48
CaixaBank S.A.				
0,375 % fällig am 03.02.2025		1.500	1.410	0,66
4,625 % fällig am 16.05.2027		700	694	0,33
Cedulas TDA Fondo de Titulizacion de Activos				
3,875 % fällig am 23.05.2025		2.800	2.785	1,31
Citigroup, Inc.				
6,462 % fällig am 24.05.2025	$	1.700	1.565	0,73
Commerzbank AG				
3,375 % fällig am 12.12.2025	€	700	694	0,33
Commonwealth Bank of Australia				
4,928 % fällig am 09.12.2026	$	2.600	2.367	1,11
Credit Suisse AG				
4,713 % fällig am 31.05.2024	€	2.100	2.094	0,98
Credit Suisse Schweiz AG				
3,390 % fällig am 05.12.2025		700	686	0,32
Dell Bank International DAC				
1,625 % fällig am 24.06.2024		1.500	1.461	0,69
Deutsche Bank AG				
2,625 % fällig am 16.12.2024	£	1.100	1.193	0,56
Deutsche Pfandbriefbank AG				
5,541 % fällig am 26.04.2024		1.500	1.753	0,82
5,958 % fällig am 29.09.2023		1.000	1.167	0,55
Federation des Caisses Desjardins du Quebec				
2,875 % fällig am 28.11.2024	€	1.200	1.181	0,55
General Motors Financial Co., Inc.				
6,290 % fällig am 17.11.2023	$	600	550	0,26
Hamburg Commercial Bank AG				
1,375 % fällig am 27.05.2025	€	1.500	1.427	0,67
6,250 % fällig am 18.11.2024		1.100	1.104	0,52
Hana Bank				
3,750 % fällig am 04.05.2026		1.400	1.386	0,65
HSBC Holdings PLC				
6,500 % fällig am 20.05.2024	£	300	349	0,16
ING Bank Australia Ltd.				
4,700 % fällig am 08.12.2025	AUD	2.400	1.448	0,68
4,728 % fällig am 26.05.2025		1.200	733	0,34
ING Groep NV				
0,100 % fällig am 03.09.2025	€	1.200	1.140	0,53
0,125 % fällig am 29.11.2025		300	282	0,13
JAB Holdings BV				
1,750 % fällig am 25.06.2026		1.200	1.117	0,52
Kreditanstalt fuer Wiederaufbau				
2,875 % fällig am 29.05.2026	€	600	€ 592	0,28
Landesbank Baden-Wuerttemberg				
2,000 % fällig am 24.02.2025	$	1.200	1.038	0,49
LeasePlan Corp. NV				
0,125 % fällig am 13.09.2023	€	600	596	0,28
Liberty Mutual Finance Europe DAC				
1,750 % fällig am 27.03.2024		2.100	2.056	0,96
Lloyds Banking Group PLC				
2,250 % fällig am 16.10.2024	£	800	883	0,41
3,500 % fällig am 01.04.2026	€	700	685	0,32
Mitsubishi HC Capital UK PLC				
0,250 % fällig am 03.02.2025		1.000	938	0,44
Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc.				
2,264 % fällig am 14.06.2025		1.000	980	0,46
3,273 % fällig am 19.09.2025		1.100	1.084	0,51
National Australia Bank Ltd.				
5,507 % fällig am 17.06.2026	£	600	700	0,33
NatWest Group PLC				
0,750 % fällig am 15.11.2025	€	800	758	0,36
2,000 % fällig am 04.03.2025		700	687	0,32
Nomura Holdings, Inc.				
2,648 % fällig am 16.01.2025	$	1.500	1.302	0,61
Realkredit Danmark A/S				
2,860 % fällig am 01.07.2023	DKK	5.200	698	0,33
Royal Bank of Canada				
3,607 % fällig am 17.01.2025	€	1.000	1.002	0,47
Societe Generale S.A.				
1,125 % fällig am 23.01.2025		400	381	0,18
Standard Chartered PLC				
1,214 % fällig am 23.03.2025 (d)	$	1.500	1.322	0,62
Sumitomo Mitsui Banking Corp.				
3,602 % fällig am 16.02.2026	€	690	681	0,32
Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd.				
2,550 % fällig am 10.03.2025	$	200	173	0,08
3,629 % fällig am 06.04.2026	€	800	790	0,37
4,800 % fällig am 15.09.2025	$	400	360	0,17
Toronto-Dominion Bank				
1,707 % fällig am 28.07.2025	€	1.600	1.530	0,72
3,650 % fällig am 20.01.2025		1.000	1.003	0,47
UBS Group AG				
1,000 % fällig am 21.03.2025		1.000	970	0,45
Van Lanschot Kempen NV				
3,500 % fällig am 31.05.2026		300	297	0,14
Wells Fargo & Co.				
1,338 % fällig am 04.05.2025		2.170	2.110	0,99
Westpac Banking Corp.				
3,457 % fällig am 04.04.2025		1.000	991	0,46
Yorkshire Building Society				
0,125 % fällig am 08.05.2024		2.600	2.515	1,18
			76.934	36,05
INDUSTRIEWERTE				
American Medical Systems Europe BV				
0,750 % fällig am 08.03.2025		300	284	0,13
BMW Finance NV				
3,609 % fällig am 09.12.2024		700	701	0,33
Burberry Group PLC				
1,125 % fällig am 21.09.2025	£	1.100	1.137	0,53
Bureau Veritas S.A.				
1,250 % fällig am 07.09.2023	€	2.100	2.089	0,98
Chanel Ceres PLC				
0,500 % fällig am 31.07.2026		700	624	0,29
Coloplast Finance BV				
4,138 % fällig am 19.05.2024		1.800	1.807	0,85
Fortum Oyj				
1,625 % fällig am 27.02.2026		1.200	1.123	0,53
Heathrow Funding Ltd.				
1,500 % fällig am 12.10.2027		1.200	1.129	0,53
InterContinental Hotels Group PLC				
1,625 % fällig am 08.10.2024		1.200	1.160	0,54
Koninklijke Philips NV				
0,500 % fällig am 22.05.2026		700	633	0,30
Nissan Motor Co. Ltd.				
1,940 % fällig am 15.09.2023		900	896	0,42
Ryanair DAC				
1,125 % fällig am 15.08.2023	€	1.200	€ 1.196	0,56
SEB S.A.				
1,500 % fällig am 31.05.2024		2.000	1.955	0,92
Tesco Corporate Treasury Services PLC				
0,875 % fällig am 29.05.2026		1.200	1.096	0,51
Thames Water Utilities Finance PLC				
4,000 % fällig am 19.06.2025	£	1.000	1.046	0,49
			16.876	7,91
VERSORGUNGSUNTERNEHMEN				
CK Hutchison Group Telecom Finance S.A.				
0,375 % fällig am 17.10.2023	€	1.900	1.880	0,88
National Grid Electricity Distribution PLC				
3,625 % fällig am 06.11.2023	£	1.400	1.617	0,76
Wintershall Dea Finance BV				
0,452 % fällig am 25.09.2023	€	1.600	1.586	0,74
			5.083	2,38
Summe Unternehmensanleihen und Wechsel			98.893	46,34
US-REGIERUNGSBEHÖRDEN				
Freddie Mac				
0,650 % fällig am 27.10.2025	$	1.500	1.246	0,58
0,800 % fällig am 28.10.2026		1.600	1.293	0,61
			2.539	1,19
US-SCHATZOBLIGATIONEN				
U.S. Treasury Inflation Protected Securities				
0,375 % fällig am 15.07.2025 (c)		11.639	10.211	4,79
NON-AGENCY-MBS				
Atlas Funding PLC				
5,432 % fällig am 25.07.2058	£	1.168	1.360	0,64
Avon Finance PLC				
5,809 % fällig am 20.09.2048		3.174	3.698	1,73
Barley Hill PLC				
5,824 % fällig am 27.08.2058		507	588	0,28
Cheshire PLC				
5,647 % fällig am 20.08.2045		721	837	0,39
Dilosk RMBS DAC				
4,070 % fällig am 20.07.2061	€	800	801	0,38
Domi BV				
4,203 % fällig am 15.11.2052		915	915	0,43
4,376 % fällig am 15.06.2051		120	120	0,06
Dutch Property Finance BV				
3,942 % fällig am 28.04.2059		603	600	0,28
3,992 % fällig am 28.10.2059		1.290	1.285	0,60
Eurosail PLC				
5,940 % fällig am 13.06.2045	£	651	751	0,35
Formentera Issuer PLC				
5,357 % fällig am 28.07.2047		1.234	1.426	0,67
Harbour				
5,358 % fällig am 28.01.2054		559	648	0,30
Hops Hill PLC				
5,854 % fällig am 27.05.2054		315	367	0,17
Kinbane DAC				
4,263 % fällig am 25.09.2062	€	1.272	1.262	0,59
Lanebrook Mortgage Transaction PLC				
5,965 % fällig am 12.06.2057	£	620	724	0,34
Mansard Mortgages PLC				
5,651 % fällig am 15.12.2049		549	627	0,29
Polaris PLC				
6,141 % fällig am 23.05.2059		1.159	1.353	0,64
Precise Mortgage Funding PLC				
5,657 % fällig am 16.10.2056		38	45	0,02
Residential Mortgage Securities PLC				
6,159 % fällig am 20.06.2070		59	70	0,03
Rochester Financing PLC				
5,602 % fällig am 18.12.2044		721	831	0,39
Shamrock Residential DAC				
4,289 % fällig am 24.12.2059	€	2.088	2.068	0,97
Stanlington PLC				
5,815 % fällig am 12.06.2045	£	790	916	0,43
Stratton BTL Mortgage Funding PLC				
5,221 % fällig am 20.01.2054		743	862	0,40

BESCHREIBUNG		PAR (000S)		MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
Stratton Mortgage Funding PLC					
5,391 % fällig am 20.07.2060	£	2.636	€	3.072	1,44
5,565 % fällig am 12.12.2043		341		396	0,19
5,792 % fällig am 25.09.2051		2.257		2.624	1,23
Towd Point Mortgage Funding PLC					
5,161 % fällig am 20.10.2051		1.700		1.961	0,92
5,635 % fällig am 20.10.2051		1.128		1.316	0,62
5,841 % fällig am 20.07.2045		646		754	0,35
6,097 % fällig am 20.05.2045		427		496	0,23
6,216 % fällig am 20.02.2045		2.391		2.781	1,30
6,546 % fällig am 20.02.2054		1.629		1.899	0,89
Tudor Rose Mortgages					
5,509 % fällig am 20.06.2048		1.621		1.878	0,88
				39.331	18,43
FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE					
Accunia European CLO DAC					
4,070 % fällig am 20.01.2031	€	3.092		3.032	1,42
4,107 % fällig am 15.10.2030		255		253	0,12
Asset-Backed European Securitisation Transaction Twenty-One BV					
4,072 % fällig am 21.09.2031		600		602	0,28
Autonoria FCT					
3,883 % fällig am 26.01.2043		800		801	0,38
Avoca CLO DAC					
3,885 % fällig am 12.01.2031		1.860		1.827	0,86
4,067 % fällig am 15.04.2033		1.730		1.689	0,79
Bavarian Sky S.A.					
3,765 % fällig am 20.03.2030		732		733	0,34
Bavarian Sky UK PLC					
5,407 % fällig am 20.04.2031	£	700		818	0,38
Black Diamond CLO DAC					
4,060 % fällig am 20.01.2032	€	167		165	0,08
BlueMountain Fuji EUR CLO DAC					
3,827 % fällig am 15.07.2030		653		642	0,30
BNPP AM Euro CLO DAC					
3,777 % fällig am 15.04.2031		200		196	0,09
Cairn CLO DAC					
3,842 % fällig am 30.04.2031		986		966	0,45
Cars Alliance Auto Loans Germany					
3,860 % fällig am 18.03.2035		900		902	0,42

BESCHREIBUNG		PAR (000S)		MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
CVC Cordatus Loan Fund DAC					
3,855 % fällig am 21.07.2030	€	556	€	547	0,26
Euro-Galaxy CLO DAC					
3,765 % fällig am 11.04.2031		591		581	0,27
3,831 % fällig am 24.04.2034		1.000		974	0,46
Ginkgo Auto Loans					
4,113 % fällig am 25.07.2043		500		502	0,24
Ginkgo Sales Finance					
4,113 % fällig am 25.11.2049		726		726	0,34
Harvest CLO DAC					
3,907 % fällig am 15.01.2031		931		915	0,43
4,250 % fällig am 26.06.2030		1.418		1.389	0,65
Jubilee CLO DAC					
3,787 % fällig am 15.04.2030		100		98	0,05
Man GLG Euro CLO DAC					
3,857 % fällig am 15.10.2030		769		755	0,35
4,047 % fällig am 15.01.2030		176		174	0,08
Oak Hill European Credit Partners Ltd.					
4,100 % fällig am 22.07.2030		115		115	0,05
OCP Euro CLO DAC					
3,997 % fällig am 15.01.2032		790		779	0,37
OZLME DAC					
4,162 % fällig am 24.08.2030		1.559		1.529	0,72
Palmer Square European Loan Funding DAC					
3,897 % fällig am 15.10.2031		563		552	0,26
3,907 % fällig am 15.07.2031		788		769	0,36
3,957 % fällig am 15.04.2031		244		239	0,11
Revocar UG					
4,032 % fällig am 21.04.2036		783		785	0,37
Silver Arrow S.A.					
3,768 % fällig am 15.02.2030		643		644	0,30
Toro European CLO DAC					
3,917 % fällig am 15.10.2030		460		451	0,21
Willow Park CLO DAC					
4,017 % fällig am 15.01.2031		1.048		1.033	0,48
				26.183	12,27
STAATSEMISSIONEN					
Cassa Depositi e Prestiti SpA					
5,750 % fällig am 05.05.2026	$	800		724	0,34

BESCHREIBUNG		PAR (000S)		MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
Development Bank of Japan, Inc.					
0,010 % fällig am 15.10.2024	€	2.600	€	2.470	1,16
4,500 % fällig am 06.06.2025	£	300		339	0,16
Korea Housing Finance Corp.					
0,010 % fällig am 05.02.2025	€	1.500		1.402	0,66
0,723 % fällig am 22.03.2025		2.000		1.884	0,88
Luxembourg Government International Bond					
2,125 % fällig am 10.07.2023		500		500	0,23
Poland Government International Bond					
0,000 % fällig am 07.07.2023 (a)		1.300		1.299	0,61
South Korea Government International Bond					
2,125 % fällig am 10.06.2024		900		885	0,42
Svensk Exportkredit AB					
3,250 % fällig am 13.04.2026		650		643	0,30
Tokyo Metropolitan Government					
4,625 % fällig am 01.06.2026	$	200		181	0,08
				10.327	4,84
KURZFRISTIGE INSTRUMENTE					
COMMERCIAL PAPER					
SGS Nederland Holding BV					
3,660 % fällig am 10.07.2023	€	700		699	0,33
Universal Music Group NV					
3,691 % fällig am 24.07.2023		500		499	0,23
				1.198	0,56
JAPAN TREASURY BILLS					
(0,197) % fällig am 31.07.2023 (a)(b)	¥	635.000		4.027	1,89
(0,183) % fällig am 10.07.2023 (a)(b)		740.000		4.693	2,20
(0,178) % fällig am 31.07.2023 (a)(b)		265.000		1.681	0,79
				10.401	4,88
Summe kurzfristige Instrumente				11.599	5,44
Summe Übertragbare Wertpapiere			€	**199.083**	**93,30**

PENSIONSGESCHÄFTE

Kontrahent	Kredit-zins	Abrechnungs-datum	Fälligkeits-datum		Kapital-betrag	Besichert durch		Sicherheiten (erhalten)		Pensions-geschäfte, zum Wert		Zu erhaltende Erlöse aus Pensions-geschäft[1]	% des Nettovermögens
COM	3,250 %	30.06.2023	03.07.2023	€	9.400	Brandenburg 0,010 % fällig am 27.04.2027	€	(9.724)	€	9.400	€	9.403	4,41
FICC	2,400	30.06.2023	03.07.2023	$	143	U.S. Treasury Notes 4,625 % fällig am 30.06.2025		(134)		131		131	0,06
Summe Pensionsgeschäfte							€	**(9.858)**	€	**9.531**	€	**9.534**	**4,47**

[1] Umfasst aufgelaufene Zinsen.

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

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

Beschreibung	Art	Ablauf-monat	Anzahl der Kontrakte		Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Euro-Bobl September Futures	Short	09.2023	521	€	869	0,41
Euro-Schatz September Futures	Short	09.2023	496		409	0,19
				€	1.278	0,60
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate				€	**1.278**	**0,60**

ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)

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

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMMISSIONEN - SCHUTZVERKAUF[1]

Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag[2]	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
AT&T, Inc.	1,000 %	20.06.2024	$ 1.000	€ 4	0,00

ZINSSWAPS

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fest-Zinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Zahlung[3]	6-Month EUR-EURIBOR	3,000 %	20.09.2028	€ 40.200	€ 60	0,03
Zahlung[3]	6-Month EUR-EURIBOR	3,500	20.09.2025	25.000	20	0,01
					€ 80	0,04
Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate					**€ 84**	**0,04**

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

(2) Der maximal mögliche Betrag, den der Fonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

(3) Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft.

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

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

DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2023	€ 242	$ 264	€ 0	€ 0	€ 0	0,00
	07.2023	$ 105	€ 97	1	0	1	0,00
	08.2023	AUD 3.582	2.199	16	0	16	0,01
BPS	07.2023	€ 26.418	$ 28.934	110	(7)	103	0,05
	07.2023	$ 489	€ 453	5	0	5	0,00
	08.2023	27.887	25.416	0	(110)	(110)	(0,05)
BRC	07.2023	€ 1.864	£ 1.603	5	(1)	4	0,00
	07.2023	£ 6.407	€ 7.419	0	(47)	(47)	(0,02)
	08.2023	¥ 8.000	55	4	0	4	0,00
	09.2023	ILS 21	$ 6	0	0	0	0,00
CBK	07.2023	€ 1.766	£ 1.511	0	(5)	(5)	0,00
JPM	07.2023	305	261	0	(1)	(1)	0,00
	07.2023	1.210	$ 1.299	0	(20)	(20)	(0,01)
	08.2023	178	¥ 25.915	0	(13)	(13)	(0,01)
	09.2023	ILS 20	$ 6	0	0	0	0,00
MBC	07.2023	€ 45.426	£ 39.222	278	0	278	0,13
	07.2023	£ 20.146	€ 23.249	0	(226)	(226)	(0,11)
	07.2023	¥ 1.200.000	8.247	614	0	614	0,30
	08.2023	€ 1.004	¥ 146.175	0	(72)	(72)	(0,03)
	08.2023	£ 38.910	€ 45.010	0	(274)	(274)	(0,13)
MYI	07.2023	€ 383	$ 419	1	0	1	0,00
	07.2023	$ 491	€ 459	9	0	9	0,00
RYL	07.2023	DKK 5.200	698	0	(1)	(1)	0,00
SOG	07.2023	$ 29.307	27.244	381	0	381	0,18
UAG	07.2023	€ 2.039	¥ 300.000	0	(131)	(131)	(0,06)
	07.2023	£ 16.260	€ 18.694	0	(254)	(254)	(0,12)
	07.2023	¥ 740.000	5.192	496	0	496	0,23
				€ 1.920	€ (1.162)	€ 758	0,36
Summe Freiverkehrsfinanzderivate						**€ 758**	**0,36**
Summe Anlagen						**€ 210.734**	**98,77**
Sonstige Aktiva und Passiva						**€ 2.625**	**1,23**
Nettovermögen						**€ 213.359**	**100,00**

ERLÄUTERUNGEN ZUR AUFSTELLUNG DES WERTPAPIERBESTANDS (Angaben in Tausend*):

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

(a) Nullkuponwertpapier.

(b) Der Kupon stellt eine Rendite bis zur Endfälligkeit dar.

(c) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

(d) Eingeschränkte Wertpapiere (31. Dezember 2022: 0,48 %):

Emittentenbeschreibung	Kupon	Fälligkeits-datum	Kauf-datum	Kosten	Markt-wert	% des Nettovermögens
Standard Chartered PLC	1,214 %	23.03.2025	21.10.2022 - 24.10.2022	$ 1.434	$ 1.322	0,62

Barmittel in Höhe von 4.603 EUR (31. Dezember 2022: 6.376 EUR) wurden zum 30. Juni 2023 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Barmittel in Höhe von 10 EUR (31. Dezember 2022: 20 EUR) wurden zum 30. Juni 2023 gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. als Sicherheit für Finanzderivate verpfändet.

Beizulegender Zeitwert[1]

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 30. Juni 2023 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie[2]	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	€ 0	€ 199.083	€ 0	€ 199.083
Pensionsgeschäfte	0	9.531	0	9.531
Finanzderivate[3]	1.278	842	0	2.120
Summen	**€ 1.278**	**€ 209.456**	**€ 0**	**€ 210.734**

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

Kategorie[2]	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	€ 0	€ 330.698	€ 0	€ 330.698
Pensionsgeschäfte	0	14.100	0	14.100
Finanzderivate[3]	2.474	623	0	3.097
Summen	**€ 2.474**	**€ 345.421**	**€ 0**	**€ 347.895**

(1) Weitere Informationen finden Sie in den Erläuterungen in Erläuterung 3.

(2) Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung des Wertpapierbestands.

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

Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC-Finanzderivate und -Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2023 und 31. Dezember 2022:

	Zum 30. Jun. 2023			Zum 31. Dez. 2022		
Kontrahent	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-engagement[1]	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-Engagement[1]
BOA	€ 17	€ 0	€ 17	€ 57	€ 0	€ 57
BPS	(2)	0	(2)	(9)	0	(9)
BRC	(39)	0	(39)	(9)	0	(9)
CBK	(5)	0	(5)	77	0	77
JPM	(34)	10	(24)	31	0	31
MBC	320	(510)	(190)	371	(230)	141
MYI	10	0	10	(25)	0	(25)
RBC	k. A.	k. A.	k. A.	(190)	20	(170)
RYL	(1)	0	(1)	k. A.	k. A.	k. A.
SCX	k. A.	k. A.	k. A.	1.972	(1.890)	82
SOG	381	(430)	(49)	k. A.	k. A.	k. A.
UAG	111	0	111	(51)	0	(51)

(1) Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären.

Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung des Wertpapierbestands zum 30. Juni 2023:

	30. Jun. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	87,45	82,88
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	5,85	10,78
Pensionsgeschäfte	4,47	3,99
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	0,60	0,70
Zentral abgerechnete Finanzderivate	0,04	(0,45)
Freiverkehrsfinanzderivate	0,36	0,63

Das Anlageportfolio des Fonds konzentriert sich zum 30. Juni 2023 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	30. Jun. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
Unternehmensanleihen und Wechsel	46,34	56,35
US-Regierungsbehörden	1,19	1,90
US-Schatzobligationen	4,79	k. A.
Non-Agency-MBS	18,43	14,24
Forderungsbesicherte Wertpapiere	12,27	6,88
Staatsemissionen	4,84	3,88
Kurzfristige Instrumente	5,44	10,41
Pensionsgeschäfte	4,47	3,99
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	0,60	0,70
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	0,00	0,00
Zinsswaps	0,04	(0,45)
Freiverkehrsfinanzderivate		
Devisenterminkontrakte	0,36	0,63
Sonstige Aktiva und Passiva	1,23	1,47
Nettovermögen	100,00	100,00

BESCHREIBUNG		PAR (000S)		MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE					
BELGIEN					
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL					
Ontex Group NV					
3,500 % fällig am 15.07.2026	€	900	€	794	0,35
CAYMAN INSELN					
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL					
Kaisa Group Holdings Ltd.					
9,750 % fällig am 28.09.2023 ^	$	300		18	0,01
CHINA					
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL					
Yango Justice International Ltd.					
8,250 % fällig am 25.11.2023 ^		300		4	0,00
TSCHECHISCHE REPUBLIK					
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL					
EP Infrastructure A/S					
1,816 % fällig am 02.03.2031	€	3.400		2.390	1,07
FINNLAND					
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL					
SBB Treasury Oyj					
0,750 % fällig am 14.12.2028		300		181	0,08
1,125 % fällig am 26.11.2029		700		411	0,18
3,831 % fällig am 08.02.2024		800		715	0,32
Summe Finnland				1.307	0,58
FRANKREICH					
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL					
Accor S.A.					
2,625 % fällig am 30.01.2025 (e)		1.100		1.038	0,46
4,375 % fällig am 30.01.2024 (e)		500		494	0,22
Air France-KLM					
1,875 % fällig am 16.01.2025		400		376	0,17
Altice France S.A.					
2,125 % fällig am 15.02.2025		1.100		1.013	0,45
3,375 % fällig am 15.01.2028		1.300		952	0,42
4,125 % fällig am 15.01.2029		1.200		874	0,39
BNP Paribas S.A.					
7,750 % fällig am 16.08.2029 (e)(g)	$	900		800	0,36
CAB SELAS					
3,375 % fällig am 01.02.2028	€	1.300		1.063	0,47
Chrome Bidco SASU					
3,500 % fällig am 31.05.2028		1.800		1.519	0,68
Electricite de France S.A.					
2,625 % fällig am 01.12.2027 (e)		1.000		809	0,36
2,875 % fällig am 15.12.2026 (e)		1.600		1.368	0,61
3,375 % fällig am 15.06.2030 (e)		1.000		771	0,34
4,000 % fällig am 04.07.2024 (e)		600		584	0,26
5,875 % fällig am 22.01.2029 (e)	£	100		97	0,04
6,000 % fällig am 29.01.2026 (e)		2.000		2.127	0,95
9,125 % fällig am 15.03.2033 (e)	$	200		188	0,08
Elior Group S.A.					
3,750 % fällig am 15.07.2026	€	1.300		1.079	0,48
Eramet S.A.					
7,000 % fällig am 22.05.2028		1.000		1.029	0,46
Forvia					
2,750 % fällig am 15.02.2027		4.000		3.633	1,62
iliad S.A.					
5,375 % fällig am 14.06.2027		2.500		2.473	1,10
Loxam S.A.S.					
2,875 % fällig am 15.04.2026		500		465	0,21
4,500 % fällig am 15.02.2027 (h)		200		192	0,09
4,500 % fällig am 15.04.2027		300		269	0,12
Renault S.A.					
1,125 % fällig am 04.10.2027		1.600		1.346	0,60
2,375 % fällig am 25.05.2026		1.700		1.576	0,70
Rexel S.A.					
2,125 % fällig am 15.12.2028		100		88	0,04
Ubisoft Entertainment S.A.					
0,878 % fällig am 24.11.2027		800		615	0,27
Vallourec S.A.					
8,500 % fällig am 30.06.2026	€	700	€	701	0,31
				27.539	12,26
STAATSEMISSIONEN					
France Government International Bond					
4,250 % fällig am 25.10.2023		2.350		2.355	1,05
Summe Frankreich				29.894	13,31
DEUTSCHLAND					
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL					
Cheplapharm Arzneimittel GmbH					
3,500 % fällig am 11.02.2027		800		728	0,32
5,500 % fällig am 15.01.2028	$	700		582	0,26
7,500 % fällig am 15.05.2030	€	1.200		1.208	0,54
Clearstream Banking AG					
0,000 % fällig am 01.12.2025 (c)		100		91	0,04
Commerzbank AG					
4,000 % fällig am 05.12.2030		1.800		1.689	0,75
6,500 % fällig am 06.12.2032		100		99	0,04
8,625 % fällig am 28.02.2033	£	1.100		1.235	0,55
CT Investment GmbH					
5,500 % fällig am 15.04.2026	€	800		745	0,33
Ctec GmbH					
5,250 % fällig am 15.02.2030		100		83	0,04
Deutsche Bank AG					
5,625 % fällig am 19.05.2031		500		478	0,21
7,079 % fällig am 10.02.2034	$	300		255	0,11
Douglas GmbH					
6,000 % fällig am 08.04.2026	€	600		553	0,25
IHO Verwaltungs GmbH					
8,750 % fällig am 15.05.2028		500		517	0,23
IHO Verwaltungs GmbH (3,875 % bar oder 4,625 % PIK)					
3,875 % fällig am 15.05.2027 (b)		1.200		1.087	0,48
IHO Verwaltungs GmbH (6,375 % bar oder 7,125 % PIK)					
6,375 % fällig am 15.05.2029 (b)	$	1.100		936	0,42
Nidda Healthcare Holding GmbH					
7,500 % fällig am 21.08.2026	€	2.600		2.593	1,15
PrestigeBidCo GmbH					
9,177 % fällig am 15.07.2027		500		505	0,23
ProGroup AG					
3,000 % fällig am 31.03.2026		1.500		1.409	0,63
Schaeffler AG					
3,375 % fällig am 12.10.2028		2.100		1.920	0,86
Techem Verwaltungsgesellschaft mbH					
2,000 % fällig am 15.07.2025		1.300		1.239	0,55
ZF Finance GmbH					
2,000 % fällig am 06.05.2027		700		611	0,27
2,250 % fällig am 03.05.2028		500		422	0,19
2,750 % fällig am 25.05.2027		2.500		2.233	0,99
5,750 % fällig am 03.08.2026		200		201	0,09
Summe Deutschland				21.419	9,53
IRLAND					
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL					
Bank of Ireland Group PLC					
6,750 % fällig am 01.03.2033		200		203	0,09
7,594 % fällig am 06.12.2032	£	600		670	0,30
James Hardie International Finance DAC					
3,625 % fällig am 01.10.2026	€	200		191	0,08
Permanent TSB Group Holdings PLC					
3,000 % fällig am 19.08.2031		800		695	0,31
Summe Irland				1.759	0,78
ITALIEN					
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL					
Banca Monte dei Paschi di Siena SpA					
1,875 % fällig am 09.01.2026		800		713	0,32
2,625 % fällig am 28.04.2025		500		469	0,21
6,750 % fällig am 02.03.2026		1.100		1.103	0,49
7,677 % fällig am 18.01.2028		900		758	0,34
10,500 % fällig am 23.07.2029		100		99	0,04
FIS Fabbrica Italiana Sintetici SpA					
5,625 % fällig am 01.08.2027		700		627	0,28
Inter Media and Communication SpA					
6,750 % fällig am 09.02.2027	€	800	€	775	0,34
Intesa Sanpaolo SpA					
6,375 % fällig am 30.03.2028 (e)(g)		200		174	0,08
8,248 % fällig am 21.11.2033	$	2.100		2.023	0,90
Italmatch Chemicals SpA					
9,098 % fällig am 06.02.2028	€	100		95	0,04
10,000 % fällig am 06.02.2028		400		391	0,17
Mundys SpA					
1,875 % fällig am 12.02.2028		4.400		3.762	1,67
Nexi SpA					
2,125 % fällig am 30.04.2029		4.100		3.428	1,53
Telecom Italia SpA					
1,625 % fällig am 18.01.2029		600		462	0,21
6,875 % fällig am 15.02.2028		1.800		1.797	0,80
Summe Italien				16.676	7,42
JAPAN					
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL					
SoftBank Group Corp.					
3,375 % fällig am 06.07.2029		300		248	0,11
4,000 % fällig am 19.09.2029		600		505	0,23
5,000 % fällig am 15.04.2028		900		840	0,37
Summe Japan				1.593	0,71
JERSEY, KANALINSELN					
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL					
G City Europe Ltd.					
4,250 % fällig am 11.09.2025		300		262	0,12
Kennedy Wilson Europe Real Estate Ltd.					
3,250 % fällig am 12.11.2025		1.600		1.420	0,63
Summe Jersey, Kanalinseln				1.682	0,75
LUXEMBURG					
WANDELANLEIHEN & WECHSEL					
Corestate Capital Holding S.A.					
1,375 % fällig am 31.07.2023 ^		200		29	0,02
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL					
Albion Financing SARL					
5,250 % fällig am 15.10.2026		800		755	0,34
Altice Financing S.A.					
3,000 % fällig am 15.01.2028		1.700		1.320	0,59
Altice France Holding S.A.					
8,000 % fällig am 15.05.2027		450		264	0,12
ARD Finance S.A. (5,000 % bar oder 5,750 % PIK)					
5,000 % fällig am 30.06.2027 (b)		350		272	0,12
ARD Finance S.A. (6,500 % bar oder 7,250 % PIK)					
6,500 % fällig am 30.06.2027 (b)	$	500		372	0,17
Cidron Aida Finco SARL					
5,000 % fällig am 01.04.2028	€	600		545	0,24
6,250 % fällig am 01.04.2028	£	1.500		1.532	0,68
Cirsa Finance International SARL					
4,500 % fällig am 15.03.2027	€	1.100		1.009	0,45
CPI Property Group S.A.					
4,875 % fällig am 16.07.2025 (e)		300		109	0,05
4,875 % fällig am 18.08.2026 (e)		300		120	0,05
InPost S.A.					
2,250 % fällig am 15.07.2027		700		610	0,27
LHMC Finco 2 SARL (7,250 % bar oder 8,000 % PIK)					
7,250 % fällig am 02.10.2025 (b)		416		412	0,18
Loarre Investments SARL					
6,500 % fällig am 15.05.2029		1.200		1.142	0,51
Logicor Financing SARL					
0,625 % fällig am 17.11.2025		200		175	0,08
0,750 % fällig am 15.07.2024		200		191	0,09
2,250 % fällig am 13.05.2025		2.200		2.048	0,91
Monitchem HoldCo 3 S.A.					
8,750 % fällig am 01.05.2028		400		396	0,18
PLT Finance SARL					
4,625 % fällig am 05.01.2026		1.200		1.169	0,52
Signa Development Finance SCS					
5,500 % fällig am 23.07.2026		200		136	0,06
Stena International S.A.					
3,750 % fällig am 01.02.2025		400		389	0,17

BESCHREIBUNG		PAR (000S)		MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
Summer BC Holdco SARL					
5,750 % fällig am 31.10.2026	€	1.850	€	1.650	0,73
Telecom Italia Capital S.A.					
6,375 % fällig am 15.11.2033	$	500		389	0,17
Trafigura Funding S.A.					
3,875 % fällig am 02.02.2026	€	700		660	0,29
				15.665	6,97
Summe Luxemburg				15.694	6,99
MULTINATIONAL					
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL					
Clarios Global LP					
4,375 % fällig am 15.05.2026		900		861	0,38
NIEDERLANDE					
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL					
CTP NV					
0,500 % fällig am 21.06.2025		1.400		1.248	0,56
Dufry One BV					
2,000 % fällig am 15.02.2027		1.200		1.050	0,47
3,625 % fällig am 15.04.2026	CHF	1.500		1.478	0,66
Energizer Gamma Acquisition BV					
3,500 % fällig am 30.06.2029	€	900		728	0,32
IPD 3 BV					
8,000 % fällig am 15.06.2028		1.100		1.125	0,50
OI European Group BV					
6,250 % fällig am 15.05.2028		1.000		1.024	0,46
Q-Park Holding BV					
3,500 % fällig am 01.02.2025		1.100		1.030	0,46
Sigma Holdco BV					
5,750 % fällig am 15.05.2026		500		435	0,19
Summer BidCo BV (9,000 % bar oder 9,750 % PIK)					
9,000 % fällig am 15.11.2025 (b)		242		216	0,10
Telefonica Europe BV					
7,125 % fällig am 23.08.2028 (e)		400		410	0,18
Teva Pharmaceutical Finance Netherlands BV					
1,875 % fällig am 31.03.2027		4.100		3.500	1,56
3,750 % fällig am 09.05.2027		100		91	0,04
7,375 % fällig am 15.09.2029		1.100		1.123	0,50
United Group BV					
3,625 % fällig am 15.02.2028		800		637	0,28
4,000 % fällig am 15.11.2027		1.100		905	0,40
ZF Europe Finance BV					
2,000 % fällig am 23.02.2026		500		456	0,20
				15.456	6,88
KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG					
Nouryon Finance BV					
6,478 % fällig am 03.04.2028		944		929	0,41
Summe Niederlande				16.385	7,29
PANAMA					
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL					
Carnival Corp.					
10,125 % fällig am 01.02.2026		1.800		1.895	0,84
SPANIEN					
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL					
Aedas Homes Opco SLU					
4,000 % fällig am 15.08.2026		700		653	0,29
Banco Santander S.A.					
4,375 % fällig am 14.01.2026 (e)(g)		800		672	0,30
Cellnex Finance Co. S.A.					
1,500 % fällig am 08.06.2028		700		599	0,27
2,000 % fällig am 15.09.2032		1.300		1.026	0,46
Cellnex Telecom S.A.					
1,750 % fällig am 23.10.2030		200		162	0,07
Grifols Escrow Issuer S.A.					
3,875 % fällig am 15.10.2028		1.400		1.202	0,54
Grifols S.A.					
2,250 % fällig am 15.11.2027		300		272	0,12
3,200 % fällig am 01.05.2025		1.300		1.268	0,56
Summe Spanien				5.854	2,61

BESCHREIBUNG		PAR (000S)		MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
SCHWEDEN					
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL					
Akelius Residential Property AB					
2,249 % fällig am 17.05.2081	€	1.200	€	990	0,44
Dometic Group AB					
2,000 % fällig am 29.09.2028		900		729	0,33
3,000 % fällig am 08.05.2026		500		469	0,21
Intrum AB					
4,875 % fällig am 15.08.2025		900		748	0,33
9,250 % fällig am 15.03.2028 (h)		1.200		1.018	0,45
Verisure Holding AB					
3,250 % fällig am 15.02.2027		1.500		1.336	0,60
3,875 % fällig am 15.07.2026		200		188	0,08
Verisure Midholding AB					
5,250 % fällig am 15.02.2029		600		522	0,23
Volvo Car AB					
4,250 % fällig am 31.05.2028		700		674	0,30
Summe Schweden				6.674	2,97
SCHWEIZ					
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL					
UBS Group AG					
6,442 % fällig am 11.08.2028	$	650		598	0,27
9,016 % fällig am 15.11.2033		600		660	0,29
Summe Schweiz				1.258	0,56
GROSSBRITANNIEN					
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL					
BCP Modular Services Finance PLC					
4,750 % fällig am 30.11.2028	€	1.800		1.539	0,68
Bellis Acquisition Co. PLC					
3,250 % fällig am 16.02.2026	£	2.800		2.739	1,22
Burford Capital PLC					
5,000 % fällig am 01.12.2026		1.300		1.383	0,61
Gatwick Airport Finance PLC					
4,375 % fällig am 07.04.2026		1.800		1.913	0,85
Harbour Energy PLC					
5,500 % fällig am 15.10.2026	$	1.000		844	0,38
Heathrow Finance PLC					
3,875 % fällig am 01.03.2027	£	400		399	0,18
4,125 % fällig am 01.09.2029		1.114		1.054	0,47
Iceland Bondco PLC					
4,375 % fällig am 15.05.2028		100		92	0,04
INEOS Finance PLC					
2,125 % fällig am 15.11.2025	€	500		470	0,21
2,875 % fällig am 01.05.2026		500		460	0,20
INEOS Quattro Finance PLC					
2,500 % fällig am 15.01.2026		2.400		2.156	0,96
Jaguar Land Rover Automotive PLC					
4,500 % fällig am 15.01.2026		900		855	0,38
4,500 % fällig am 15.07.2028		300		263	0,12
6,875 % fällig am 15.11.2026		500		498	0,22
John Lewis PLC					
4,250 % fällig am 18.12.2034	£	240		174	0,08
6,125 % fällig am 21.01.2025		300		337	0,15
Lloyds Banking Group PLC					
7,500 % fällig am 27.09.2025 (e)(g)	$	600		516	0,23
Market Bidco Finco PLC					
4,750 % fällig am 04.11.2027	€	1.200		969	0,43
5,500 % fällig am 04.11.2027	£	800		728	0,32
Marks & Spencer PLC					
3,750 % fällig am 19.05.2026		1.300		1.367	0,61
PEU Fin PLC					
7,250 % fällig am 01.07.2028	€	900		902	0,40
Pinnacle Bidco PLC					
5,500 % fällig am 15.02.2025		500		482	0,21
6,375 % fällig am 15.02.2025	£	2.800		3.116	1,39
Rolls-Royce PLC					
3,375 % fällig am 18.06.2026		1.580		1.628	0,72
4,625 % fällig am 16.02.2026	€	2.600		2.562	1,14
Thames Water Kemble Finance PLC					
4,625 % fällig am 19.05.2026	£	800		485	0,22
Travis Perkins PLC					
3,750 % fällig am 17.02.2026		600		629	0,28

BESCHREIBUNG		PAR (000S)		MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
Virgin Media Secured Finance PLC					
4,250 % fällig am 15.01.2030	£	4.000	€	3.679	1,64
Vmed O2 UK Financing PLC					
3,250 % fällig am 31.01.2031	€	700		577	0,26
4,000 % fällig am 31.01.2029	£	1.400		1.300	0,58
4,250 % fällig am 31.01.2031	$	200		148	0,07
Zenith Finco PLC					
6,500 % fällig am 30.06.2027	£	800		712	0,32
				34.976	15,57
KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG					
Lorca Holdco Ltd.					
7,522 % fällig am 17.09.2027	€	2.300		2.229	0,99
Summe Großbritannien				37.205	16,56
USA					
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL					
American Airlines Pass-Through Trust					
3,375 % fällig am 01.11.2028	$	871		716	0,32
3,700 % fällig am 01.04.2028		1.762		1.454	0,65
Avantor Funding, Inc.					
3,875 % fällig am 15.07.2028	€	900		827	0,37
Burford Capital Global Finance LLC					
9,250 % fällig am 01.07.2031	$	300		274	0,12
Chemours Co.					
4,000 % fällig am 15.05.2026	€	1.400		1.303	0,58
Coty, Inc.					
3,875 % fällig am 15.04.2026		2.100		2.041	0,91
Credit Suisse AG AT1 Claim ^	$	800		29	0,01
Ford Motor Credit Co. LLC					
3,625 % fällig am 17.06.2031		3.400		2.558	1,14
Gap, Inc.					
3,875 % fällig am 01.10.2031		800		503	0,22
Graphic Packaging International LLC					
2,625 % fällig am 01.02.2029	€	200		176	0,08
IQVIA, Inc.					
2,250 % fällig am 15.03.2029		800		685	0,30
Kronos International, Inc.					
3,750 % fällig am 15.09.2025		1.400		1.281	0,57
Olympus Water U.S. Holding Corp.					
3,875 % fällig am 01.10.2028		1.700		1.346	0,60
Organon & Co.					
2,875 % fällig am 30.04.2028		1.800		1.567	0,70
Rio Oil Finance Trust					
8,200 % fällig am 06.04.2028	$	1.372		1.265	0,56
SCIL LLC					
9,500 % fällig am 15.07.2028 (a)	€	600		600	0,27
Spectrum Brands, Inc.					
4,000 % fällig am 01.10.2026		2.400		2.310	1,03
Standard Industries, Inc.					
2,250 % fällig am 21.11.2026		2.700		2.405	1,07
Venture Global LNG, Inc.					
8,125 % fällig am 01.06.2028	$	900		839	0,37
8,375 % fällig am 01.06.2031		900		833	0,37
WMG Acquisition Corp.					
2,250 % fällig am 15.08.2031	€	1.400		1.115	0,50
Summe USA				24.127	10,74
KURZFRISTIGE INSTRUMENTE					
EUROPEAN STABILITY MECHANISM TREASURY BILLS					
3,052 % fällig am 18.08.2023 (c)(d)		680		677	0,30
3,070 % fällig am 18.08.2023 (c)(d)		1.810		1.803	0,81
3,337 % fällig am 07.09.2023 (c)(d)		250		249	0,11
				2.729	1,22
EUROPEAN UNION TREASURY BILLS					
3,172 % fällig am 04.08.2023 (c)(d)		150		150	0,07
3,173 % fällig am 04.08.2023 (c)(d)		250		249	0,11
3,179 % fällig am 04.08.2023 (c)(d)		200		199	0,09
3,326 % fällig am 08.09.2023 (c)(d)		150		149	0,06
				747	0,33

BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERM-ÖGENS
FRANCE TREASURY BILLS			
3,094 % fällig am 19.07.2023 (c)(d)	€ 5.150	€ 5.142	2,29
3,096 % fällig am 19.07.2023 (c)(d)	1.870	1.867	0,83
3,127 % fällig am 02.08.2023 (c)(d)	500	499	0,22
3,135 % fällig am 02.08.2023 (c)(d)	450	449	0,20
		7.957	3,54

BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERM-ÖGENS
GERMANY TREASURY BILLS			
3,143 % fällig am 19.07.2023 (c)(d)	€ 4.950	€ 4.942	2,20
Summe kurzfristige Instrumente		16.375	7,29
Summe Übertragbare Wertpapiere		**€ 203.864**	**90,74**

BESCHREIBUNG	AKTIEN	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERM-ÖGENS
INVESTMENTFONDS			
BÖRSENGEHANDELTE FONDS			
PIMCO ETFs plc - PIMCO Euro Short Maturity UCITS ETF (f)	120.900	€11.682	5,20
Summe Investmentfonds		**€ 11.682**	**5,20**

PENSIONSGESCHÄFTE

Kontrahent	Kredit-zins	Abrechnungs-datum	Fälligkeits-datum	Kapital-betrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensions-geschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensions-geschäft[1]	% des Nettovermögens
BPS	3,100 %	30.06.2023	03.07.2023	€ 3.200	Europäische Union 3,250 % fällig am 04.07.2034	€ (3.250)	€ 3.200	€ 3.201	1,42
Summe Pensionsgeschäfte						**€ (3.250)**	**€ 3.200**	**€ 3.201**	**1,42**

[1] Umfasst aufgelaufene Zinsen.

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

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

FUTURES

Beschreibung	Art	Ablauf-monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Euro-Bobl September Futures	Long	09.2023	146	€ (202)	(0,09)
Euro-Bund 10-Year Bond September Futures	Short	09.2023	11	14	0,01
Euro-Buxl 30-Year Bond September Futures	Short	09.2023	1	(2)	0,00
Euro-Schatz September Futures	Long	09.2023	372	(327)	(0,15)
U.S. Treasury 2-Year Note September Futures	Short	09.2023	58	124	0,06
U.S. Treasury 5-Year Note September Futures	Short	09.2023	57	93	0,04
U.S. Treasury 10-Year Ultra September Futures	Short	09.2023	27	34	0,01
United Kingdom Long Gilt September Futures	Short	09.2023	6	6	0,00
				€ (260)	(0,12)
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate				**€ (260)**	**(0,12)**

ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)

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

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMMISSIONEN - SCHUTZVERKAUF[1]

Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag[2]	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Jaguar Land Rover Automotive PLC	5,000 %	20.12.2027	€ 100	€ 11	0,01
United Group BV	5,000	20.12.2027	700	82	0,03
				€ 93	0,04

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES - SCHUTZVERKAUF[1]

Index/Tranchen	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag[2]	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
iTraxx Crossover 39 5-Year Index	5,000 %	20.06.2028	€ 25.900	€ 396	0,18

ZINSSWAPS

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Erhalt[3]	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	3,750 %	20.09.2028	£ 1.500	€ 102	0,04
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	0,000	16.09.2023	$ 6.800	(89)	(0,04)
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,000	16.12.2025	3.800	408	0,18
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,000	16.12.2030	3.000	508	0,23
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,750	15.06.2027	800	26	0,01
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	0,000	16.09.2023	6.800	90	0,04
Erhalt[3]	6-Month EUR-EURIBOR	2,500	20.09.2053	€ 200	(4)	0,00
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,547	09.03.2033	1.500	(30)	(0,01)
Zahlung[3]	6-Month EUR-EURIBOR	3,500	20.09.2025	3.300	(19)	(0,01)
					€ 992	0,44
					€ 1.481	**0,66**

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

(2) Der maximal mögliche Betrag, den der Fonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

(3) Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft.

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

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

VERKAUFSOPTIONEN

ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag[1]	Aufgeld	Markt-wert	% des Nettovermögens
GLM	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,018 %	20.10.2023	1.300	€ (8)	€ 0	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,018	20.10.2023	1.300	(8)	(24)	(0,01)
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,140	23.10.2023	1.300	(9)	0	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,140	23.10.2023	1.300	(9)	(23)	(0,01)
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,190	23.10.2023	1.300	(8)	0	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,190	23.10.2023	1.300	(8)	(23)	(0,01)
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,225	23.10.2023	1.300	(8)	0	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,225	23.10.2023	1.300	(8)	(22)	(0,01)
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,973	25.10.2023	1.300	(8)	0	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,973	25.10.2023	1.300	(8)	(25)	(0,01)
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,841	27.10.2023	1.300	(9)	0	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,841	27.10.2023	1.300	(8)	(26)	(0,01)
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,088	03.11.2023	400	(3)	0	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,088	03.11.2023	400	(3)	(7)	(0,01)
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,721	08.04.2024	100	(1)	0	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,721	08.04.2024	100	(1)	(2)	0,00
							€ (107)	€ (152)	(0,07)

(1) Der Nennbetrag stellt die Anzahl der Kontrakte dar.

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMMISSIONEN - SCHUTZVERKAUF[1]

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag[2]	Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Markt-wert	% des Nettovermögens
BPS	Deutsche Bank AG	1,000 %	20.06.2027	€ 600	€ (81)	€ 47	€ (34)	(0,01)
GST	EP Infrastructure A/S	5,000	20.06.2028	600	(12)	22	10	0,00
					€ (93)	€ 69	€ (24)	(0,01)

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

(2) Der maximal mögliche Betrag, den der Fonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2023	CHF 1.347	€ 1.392	€ 12	€ 0	€ 12	0,01
	07.2023	€ 270	$ 293	0	(1)	(1)	0,00
	07.2023	£289	€ 336	0	(1)	(1)	0,00
	07.2023	$ 146	133	0	(1)	(1)	0,00
BPS	07.2023	€ 17.259	$ 18.911	74	0	74	0,03
	07.2023	$ 150	€ 140	3	0	3	0,00
	08.2023	18.937	17.259	0	(75)	(75)	(0,03)
BRC	07.2023	£ 3.346	3.874	0	(25)	(25)	(0,01)
MBC	07.2023	€ 27.636	£ 23.862	170	0	170	0,08
	07.2023	£ 11.075	€ 12.781	0	(125)	(125)	(0,06)
	08.2023	23.890	27.636	0	(167)	(167)	(0,07)
MYI	07.2023	318	368	0	(2)	(2)	0,00
	07.2023	$ 570	533	11	0	11	0,00
SOG	07.2023	17.988	16.722	234	0	234	0,10
UAG	07.2023	€ 1.392	CHF 1.362	4	0	4	0,00
	07.2023	£ 8.939	€ 10.277	0	(140)	(140)	(0,06)
	08.2023	CHF 1.360	1.392	0	(4)	(4)	0,00
				€ 508	€ (541)	€ (33)	(0,01)

Summe Freiverkehrsfinanzderivate	**€ (209)**	**(0,09)**
Summe Anlagen	**€ 219.758**	**97,81**
Sonstige Aktiva und Passiva	**€ 4.915**	**2,19**
Nettovermögen	**€ 224.673**	**100,00**

ERLÄUTERUNGEN ZUR AUFSTELLUNG DES WERTPAPIERBESTANDS (Angaben in Tausend*):

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

^ **Das Wertpapier ist in Verzug.**

(a) **Wertpapier per Emissionstermin.**

(b) **Wertpapier mit Sachwertausschüttung.**

(c) **Nullkuponwertpapier.**

(d) **Der Kupon stellt eine Rendite bis zur Endfälligkeit dar.**

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

(f) **Mit dem Fonds verbunden.**

(g) **Bedingt wandelbares Wertpapier.**

(h) **Wertpapiere mit einem gesamten beizulegenden Zeitwert von 786 EUR (31. Dezember 2022: null EUR) wurden zum 30. Juni 2023 gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen als Sicherheit für Pensionsgeschäfte verpfändet.**

Barmittel in Höhe von 3.816 EUR (31. Dezember 2022: 2.986 EUR) wurden zum 30. Juni 2023 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Barmittel in Höhe von 190 EUR (31. Dezember 2022: null EUR) wurden zum 30. Juni 2023 gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. als Sicherheit für Finanzderivate verpfändet.

Beizulegender Zeitwert[1]

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 30. Juni 2023 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie[2]	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	€ 0	€ 203.379	€ 485	€ 203.864
Investmentfonds	0	11.682	0	11.682
Pensionsgeschäfte	0	3.200	0	3.200
Finanzderivate[3]	(511)	1.523	0	1.012
Summen	**€ (511)**	**€ 219.784**	**€ 485**	**€ 219.758**

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

Kategorie[2]	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	€ 0	€ 157.222	€ 0	€ 157.222
Investmentfonds	8.700	0	0	8.700
Pensionsgeschäfte	0	3.700	0	3.700
Finanzderivate[3]	(769)	1.671	0	902
Summen	**€ 7.931**	**€ 162.593**	**€ 0**	**€ 170.524**

(1) Weitere Informationen finden Sie in den Erläuterungen in Erläuterung 3.

(2) Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung des Wertpapierbestands.

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

Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2023:

Kontrahent	Kredit-zins	Abrechnungs-datum	Fälligkeits-datum	Kredit-betrag	Verbindlichkeiten aus umgekehrten Pensions-geschäften	% des Nettovermögens
MYI	1,750 %	10.05.2023	TBD[1]	€ (191)	€ (191)	(0,08)
	2,200	31.05.2023	TBD[1]	(644)	(646)	(0,29)
Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte					**€ (837)**	**(0,37)**

(1) Umgekehrtes Pensionsgeschäft mit offener Laufzeit.

Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC-Finanzderivate und -Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2023 und 31. Dezember 2022:

	Zum 30. Jun. 2023			Zum 31. Dez. 2022		
Kontrahent	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-engagement[1]	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-engagement[1]
BOA	€ 9	€ 0	€ 9	€ (11)	€ 0	€ (11)
BPS	(32)	50	18	(22)	0	(22)
BRC	(25)	0	(25)	80	0	80
CBK	k. A.	k. A.	k. A.	19	0	19
GLM	(152)	0	(152)	(198)	0	(198)
GST	10	0	10	k. A.	k. A.	k. A.
MBC	(122)	0	(122)	230	0	230
MYI	9	0	9	(8)	0	(8)
SCX	k. A.	k. A.	k. A.	207	0	207
SOG	234	(270)	(36)	k. A.	k. A.	k. A.
UAG	(140)	140	0	k. A.	k. A.	k. A.

[1] Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären.

Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung des Wertpapierbestands zum 30. Juni 2023:

	30. Jun. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	83,73	80,86
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	7,00	8,16
Sonstige übertragbare Wertpapiere	0,01	1,26
Investmentfonds	5,20	5,00
Pensionsgeschäfte	1,42	2,12
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	(0,12)	(0,40)
Zentral abgerechnete Finanzderivate	0,66	0,74
Freiverkehrsfinanzderivate	(0,09)	0,17
Umgekehrte Pensionsgeschäfte	(0,37)	k. A.

Das Anlageportfolio des Fonds konzentriert sich zum 30. Juni 2023 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	30. Jun. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
Belgien	0,35	k. A.
Cayman-Inseln	0,01	0,02
China	0,00	0,01
Tschechische Republik	1,07	1,23
Dänemark	k. A.	1,34
Finnland	0,58	k. A.
Frankreich	13,31	12,16
Deutschland	9,53	6,94
Irland	0,78	1,03
Insel Man	k. A.	1,03
Italien	7,42	8,16
Japan	0,71	0,97
Jersey, Kanalinseln	0,75	1,28
Luxemburg	6,99	8,62
Multinational	0,38	0,53
Niederlande	7,29	6,59
Panama	0,84	0,74
Spanien	2,61	2,40
Schweden	2,97	4,04
Schweiz	0,56	0,90
Großbritannien	16,56	12,74
USA	10,74	8,45
Kurzfristige Instrumente	7,29	11,10
Investmentfonds	5,20	5,00
Pensionsgeschäfte	1,42	2,12
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	(0,12)	(0,40)
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	0,04	0,00
Credit Default Swaps auf Kreditindizes— Schutzverkauf	0,18	0,17
Zinsswaps	0,44	0,57
Freiverkehrsfinanzderivate		
Verkaufsoptionen		
Zinsswapoptionen	(0,07)	(0,12)
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	(0,01)	(0,02)
Devisenterminkontrakte	(0,01)	0,31
Sonstige Aktiva und Passiva	2,19	2,09
Nettovermögen	100,00	100,00

BESCHREIBUNG		PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
BANKEN UND FINANZEN				
ABN AMRO Bank NV				
4,375 % fällig am 22.09.2025 (c)(e)	€	800	€ 723	0,49
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A.				
5,875 % fällig am 24.09.2023 (c)(e)		0	0	0,00
5,875 % fällig am 24.09.2023 (c)		0	0	0,00
Banco Santander S.A.				
3,625 % fällig am 21.03.2029 (c)(e)		600	396	0,27
Bank of Ireland Group PLC				
7,500 % fällig am 19.05.2025 (c)(e)		300	295	0,20
Barclays PLC				
2,885 % fällig am 31.01.2027		900	855	0,58
7,437 % fällig am 02.11.2033	$	600	595	0,40
7,750 % fällig am 15.09.2023 (c)(e)		200	180	0,12
Bevco Lux SARL				
1,000 % fällig am 16.01.2030	€	1.300	1.014	0,69
Cooperatieve Rabobank UA				
4,875 % fällig am 29.06.2029 (c)(e)		200	168	0,11
Credit Suisse AG				
4,713 % fällig am 31.05.2024		900	897	0,61
6,500 % fällig am 08.08.2023 (e)	$	400	365	0,25
Credit Suisse AG AT1 Claim ^		700	26	0,02
Credit Suisse Schweiz AG				
3,390 % fällig am 05.12.2025	€	900	881	0,60
CTP NV				
0,500 % fällig am 21.06.2025		800	713	0,48
0,625 % fällig am 27.09.2026		500	404	0,27
Deutsche Bank AG				
2,222 % fällig am 18.09.2024	$	200	181	0,12
2,625 % fällig am 16.12.2024	£	1.200	1.302	0,88
3,875 % fällig am 12.02.2024		500	570	0,39
DVI Deutsche Vermögens- & Immobilienverwaltungs GmbH				
2,500 % fällig am 25.01.2027	€	1.400	1.064	0,72
Ford Motor Credit Co. LLC				
1,744 % fällig am 19.07.2024		400	387	0,26
2,748 % fällig am 14.06.2024	£	900	1.004	0,68
Goldman Sachs Group, Inc.				
4,281 % fällig am 07.02.2025	€	1.100	1.105	0,75
HSBC Holdings PLC				
6,254 % fällig am 09.03.2034	$	1.000	940	0,64
ING Belgium S.A.				
3,375 % fällig am 31.05.2027	€	700	695	0,47
ING Groep NV				
4,875 % fällig am 16.05.2029 (c)(e)	$	200	143	0,10
Intesa Sanpaolo SpA				
3,625 % fällig am 30.06.2028	€	500	497	0,34
Jyske Realkredit A/S				
0,500 % fällig am 01.10.2040	DKK	0	0	0,00
1,000 % fällig am 01.10.2050		23	2	0,00
1,000 % fällig am 01.10.2053		0	0	0,00
1,500 % fällig am 01.10.2050		0	0	0,00
LeasePlan Corp. NV				
3,500 % fällig am 09.04.2025	€	1.200	1.179	0,80
Liberty Living Finance PLC				
2,625 % fällig am 28.11.2024	£	1.200	1.309	0,88
Logicor Financing SARL				
0,750 % fällig am 15.07.2024	€	700	667	0,45
NatWest Group PLC				
3,073 % fällig am 22.05.2028	$	200	165	0,11
4,269 % fällig am 22.03.2025		300	270	0,18
6,016 % fällig am 02.03.2034		300	277	0,19
Nordea Kredit Realkreditaktieselskab				
0,500 % fällig am 01.10.2040	DKK	0	0	0,00
1,000 % fällig am 01.10.2050		0	0	0,00
1,000 % fällig am 01.10.2053		0	0	0,00
1,500 % fällig am 01.10.2050		21	2	0,00
1,500 % fällig am 01.10.2053		599	57	0,04
Nova Kreditna Banka Maribor d.d.				
1,875 % fällig am 27.01.2025	€	800	774	0,52
Nova Ljubljanska Banka d.d.				
3,650 % fällig am 19.11.2029		400	340	0,23
10,750 % fällig am 28.11.2032		900	963	0,65
Nykredit Realkredit A/S				
0,500 % fällig am 01.10.2040	DKK	0	€ 0	0,00
1,000 % fällig am 01.10.2050		45	4	0,00
1,000 % fällig am 01.10.2053		38	3	0,00
1,500 % fällig am 01.10.2050		0	0	0,00
1,500 % fällig am 01.10.2053		4.489	400	0,27
2,000 % fällig am 01.10.2053		42	4	0,00
3,000 % fällig am 01.10.2053		2.154	254	0,17
3,500 % fällig am 01.10.2053		12.626	1.549	1,05
5,000 % fällig am 01.10.2053		8.748	1.157	0,78
Permanent TSB Group Holdings PLC				
2,125 % fällig am 26.09.2024	€	1.000	992	0,67
5,250 % fällig am 30.06.2025		600	595	0,40
Realkredit Danmark A/S				
1,000 % fällig am 01.10.2050	DKK	0	0	0,00
1,000 % fällig am 01.10.2053		50	5	0,00
1,500 % fällig am 01.10.2053		273	26	0,02
2,000 % fällig am 01.10.2053		37.278	3.699	2,50
3,000 % fällig am 01.10.2053		29	4	0,00
Sagax AB				
2,000 % fällig am 17.01.2024	€	261	256	0,17
Santander UK Group Holdings PLC				
6,534 % fällig am 10.01.2029	$	800	739	0,50
Sirius Real Estate Ltd.				
1,125 % fällig am 22.06.2026	€	400	331	0,22
Societe Generale S.A.				
6,691 % fällig am 10.01.2034	$	200	187	0,13
7,875 % fällig am 18.12.2023 (c)(e)		0	0	0,00
Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd.				
3,629 % fällig am 06.04.2026	€	400	395	0,27
Toronto-Dominion Bank				
3,879 % fällig am 13.03.2026		500	499	0,34
UniCredit Bank Czech Republic & Slovakia A/S				
3,625 % fällig am 15.02.2026		400	394	0,27
UniCredit SpA				
3,375 % fällig am 31.01.2027		500	493	0,33
Virgin Money UK PLC				
4,625 % fällig am 29.10.2028		500	470	0,32
Volkswagen Bank GmbH				
1,875 % fällig am 31.01.2024		2.700	2.666	1,80
Volkswagen Financial Services NV				
0,875 % fällig am 20.02.2025	£	400	425	0,29
Westpac Banking Corp.				
3,457 % fällig am 04.04.2025	€	700	694	0,47
			37.646	25,46
INDUSTRIEWERTE				
Abertis Infraestructuras S.A.				
3,375 % fällig am 27.11.2026	£	200	207	0,14
GN Store Nord A/S				
0,875 % fällig am 25.11.2024	€	1.300	1.213	0,82
John Lewis PLC				
6,125 % fällig am 21.01.2025	£	500	561	0,38
Market Bidco Finco PLC				
4,750 % fällig am 04.11.2027	€	600	485	0,33
Prosus NV				
3,257 % fällig am 19.01.2027	$	1.100	912	0,62
Silfin NV				
2,875 % fällig am 11.04.2027	€	700	630	0,42
Travis Perkins PLC				
4,500 % fällig am 07.09.2023	£	1.100	1.271	0,86
			5.279	3,57
VERSORGUNGSUNTERNEHMEN				
Electricite de France S.A.				
2,625 % fällig am 01.12.2027 (c)	€	800	648	0,44
2,875 % fällig am 15.12.2026 (c)		1.000	855	0,57
			1.503	1,01
Summe Unternehmensanleihen und Wechsel			44.428	30,04
US-REGIERUNGSBEHÖRDEN				
Uniform Mortgage-Backed Security, TBA				
4,000 % fällig am 01.08.2053	$	3.050	2.626	1,78
4,500 % fällig am 01.08.2053		12.200	10.757	7,27
			13.383	9,05
US-SCHATZOBLIGATIONEN				
U.S. Treasury Inflation Protected Securities (b)				
0,125 % fällig am 15.07.2031	$	1.584	€ 1.288	0,87
0,125 % fällig am 15.02.2051		816	500	0,34
0,375 % fällig am 15.07.2025		8.442	7.406	5,01
0,500 % fällig am 15.01.2028		861	738	0,50
1,625 % fällig am 15.10.2027		2.457	2.220	1,50
			12.152	8,22
NON-AGENCY-MBS				
Alba PLC				
5,171 % fällig am 15.12.2038	£	608	678	0,46
Atlas Funding PLC				
5,937 % fällig am 20.01.2061		99	116	0,08
Avon Finance PLC				
5,809 % fällig am 20.09.2048		838	977	0,66
Barley Hill PLC				
5,824 % fällig am 27.08.2058		254	294	0,20
Charter Mortgage Funding PLC				
5,327 % fällig am 16.01.2057		162	189	0,13
Cheshire PLC				
5,647 % fällig am 20.08.2045		240	279	0,19
Dilosk RMBS DAC				
4,133 % fällig am 20.02.2060	€	379	379	0,26
4,272 % fällig am 20.12.2060		770	768	0,52
Domi BV				
4,376 % fällig am 15.06.2051		168	168	0,11
Dutch Property Finance BV				
3,892 % fällig am 28.07.2058		653	652	0,44
3,942 % fällig am 28.04.2059		679	675	0,46
3,992 % fällig am 28.10.2059		737	734	0,50
4,492 % fällig am 28.04.2050		415	408	0,28
Eurosail PLC				
3,629 % fällig am 13.03.2045		77	77	0,05
Glenbeigh Issuer DAC				
4,350 % fällig am 24.06.2050		301	300	0,20
Harbour				
5,358 % fällig am 28.01.2054	£	559	648	0,44
Harmony French Home Loans				
4,107 % fällig am 27.05.2062	€	327	328	0,22
Hops Hill PLC				
6,204 % fällig am 27.11.2054	£	291	341	0,23
Jubilee Place BV				
4,177 % fällig am 17.10.2057	€	177	177	0,12
Landmark Mortgage Securities PLC				
4,865 % fällig am 17.04.2044	£	578	652	0,44
Lanebrook Mortgage Transaction PLC				
5,141 % fällig am 20.07.2058		490	565	0,38
5,965 % fällig am 12.06.2057		434	507	0,34
Miravet SARL				
4,265 % fällig am 26.05.2065	€	485	477	0,32
Polaris PLC				
5,631 % fällig am 23.12.2058	£	868	1.007	0,68
5,640 % fällig am 23.10.2059		467	540	0,37
6,154 % fällig am 27.05.2057		322	375	0,25
Precise Mortgage Funding PLC				
6,065 % fällig am 12.12.2055		279	327	0,22
Primrose Residential DAC				
4,189 % fällig am 24.03.2061	€	2.540	2.522	1,71
4,439 % fällig am 24.10.2061		778	770	0,52
Residential Mortgage Securities PLC				
6,159 % fällig am 20.06.2070	£	416	486	0,33
Resloc UK PLC				
5,161 % fällig am 15.12.2043		263	296	0,20
Ripon Mortgages PLC				
5,491 % fällig am 28.08.2056		918	1.066	0,72
Shamrock Residential DAC				
4,289 % fällig am 24.12.2059	€	648	642	0,43
Stanlington PLC				
5,815 % fällig am 12.06.2045	£	474	550	0,37
Stratton Mortgage Funding PLC				
5,391 % fällig am 20.07.2060		1.627	1.896	1,28
5,565 % fällig am 12.12.2043		477	554	0,38
5,765 % fällig am 12.03.2052		503	584	0,40
5,792 % fällig am 25.09.2051		889	1.034	0,70

BESCHREIBUNG		PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
Towd Point Mortgage Funding PLC				
5,161 % fällig am 20.10.2051	£	500	€ 577	0,39
5,841 % fällig am 20.07.2045		294	343	0,23
6,097 % fällig am 20.05.2045		640	744	0,50
6,546 % fällig am 20.02.2054		562	655	0,44
Tower Bridge Funding PLC				
5,527 % fällig am 20.11.2063		719	833	0,56
Trinity Square PLC				
5,316 % fällig am 15.07.2059		765	890	0,60
Tudor Rose Mortgages				
5,509 % fällig am 20.06.2048		261	303	0,21
Twin Bridges PLC				
6,115 % fällig am 12.12.2054		471	550	0,37
			27.933	18,89
FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE				
Adagio CLO DAC				
3,897 % fällig am 15.10.2031	€	300	294	0,20
Ares European CLO DAC				
3,957 % fällig am 15.10.2031		500	491	0,33
Armada Euro CLO DAC				
3,897 % fällig am 15.07.2031		700	685	0,46
Asset-Backed European Securitisation Transaction Twenty-One BV				
4,072 % fällig am 21.09.2031		200	201	0,14
Aurium CLO DAC				
3,847 % fällig am 16.04.2030		198	195	0,13
3,907 % fällig am 16.01.2031		999	979	0,66
4,618 % fällig am 23.03.2032		754	743	0,50
Auto ABS French Leases FCT				
4,111 % fällig am 29.06.2033		793	795	0,54
Bain Capital Euro CLO DAC				
3,940 % fällig am 20.01.2032		596	583	0,39
Bavarian Sky S.A.				
4,055 % fällig am 20.05.2027		26	26	0,02
BBVA Consumer Auto				
0,270 % fällig am 20.07.2031		118	115	0,08
Black Diamond CLO DAC				
4,060 % fällig am 20.01.2032		502	495	0,33
4,303 % fällig am 15.05.2032		500	489	0,33
BlueMountain Fuji EUR CLO DAC				
1,050 % fällig am 15.01.2031		99	92	0,06
3,827 % fällig am 15.07.2030		523	513	0,35
3,897 % fällig am 15.01.2031		597	584	0,39
4,087 % fällig am 15.01.2033		800	780	0,53
BNPP AM Euro CLO DAC				
3,827 % fällig am 15.10.2031		296	289	0,20
4,031 % fällig am 22.07.2032		800	782	0,53
Bridgepoint CLO DAC				
4,387 % fällig am 15.01.2034	€	300	€ 296	0,20
Bumper UK Finance PLC				
5,287 % fällig am 20.12.2030	£	193	225	0,15
Carlyle Euro CLO DAC				
3,877 % fällig am 15.01.2031	€	398	390	0,26
3,953 % fällig am 15.08.2030		453	443	0,30
4,213 % fällig am 15.08.2032		800	782	0,53
Carlyle Global Market Strategies Euro CLO DAC				
3,991 % fällig am 25.01.2032		799	782	0,53
Carlyle Global Market Strategies Euro CLO Ltd.				
4,073 % fällig am 15.11.2031		1.100	1.079	0,73
Citizen Irish Auto Receivables Trust DAC				
4,148 % fällig am 15.12.2029		215	216	0,15
Compartment VCL				
4,072 % fällig am 21.01.2028		321	322	0,22
Contego CLO DAC				
3,851 % fällig am 23.01.2030		499	489	0,33
CVC Cordatus Loan Fund DAC				
3,827 % fällig am 15.10.2031		1.800	1.766	1,19
4,156 % fällig am 15.09.2031		300	294	0,20
Dryden Euro CLO DAC				
3,837 % fällig am 15.04.2033		400	391	0,26
FCT Pulse France				
4,163 % fällig am 25.01.2035		400	401	0,27
Harvest CLO DAC				
1,040 % fällig am 15.07.2031		400	365	0,25
3,817 % fällig am 15.10.2031		600	586	0,40
3,880 % fällig am 20.10.2031		1.800	1.763	1,19
3,937 % fällig am 15.07.2031		700	683	0,46
4,027 % fällig am 15.01.2032		1.200	1.174	0,79
4,250 % fällig am 26.06.2030		620	608	0,41
Man GLG Euro CLO DAC				
3,857 % fällig am 15.10.2030		293	288	0,19
3,987 % fällig am 15.10.2032		599	584	0,39
Palmer Square European Loan Funding DAC				
3,897 % fällig am 15.10.2031		1.032	1.011	0,68
3,907 % fällig am 15.07.2031		875	855	0,58
4,227 % fällig am 15.10.2031		1.223	1.205	0,82
PBD Germany Auto Lease Master S.A., Compartment				
4,139 % fällig am 26.11.2030		366	366	0,25
Red & Black Auto Lease France				
4,093 % fällig am 27.06.2035		400	400	0,27
Sculptor European CLO DAC				
3,916 % fällig am 14.01.2032		700	688	0,47
Segovia European CLO DAC				
3,945 % fällig am 18.01.2031		176	173	0,12
4,080 % fällig am 20.07.2032		800	780	0,53
Silver Arrow Merfina SRL				
4,055 % fällig am 20.07.2033	€	463	€ 464	0,31
Silver Arrow S.A.				
4,028 % fällig am 15.02.2027		21	21	0,01
Tikehau CLO DAC				
4,144 % fällig am 04.08.2034		600	586	0,40
Toro European CLO DAC				
3,995 % fällig am 12.01.2032		1.200	1.177	0,80
4,133 % fällig am 15.02.2034		1.000	973	0,66
Turbo Finance PLC				
5,617 % fällig am 20.08.2028	£	83	97	0,07
Voya Euro CLO DAC				
3,927 % fällig am 15.10.2030	€	288	284	0,19
			32.138	21,73
STAATSEMISSIONEN				
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro				
1,300 % fällig am 15.05.2028 (b)		857	840	0,57
1,400 % fällig am 26.05.2025 (b)		10.425	10.323	6,98
Bundesrepublik Deutschland				
4,250 % fällig am 04.07.2039		300	369	0,25
Slovenia Government International Bond				
1,175 % fällig am 13.02.2062		1.300	735	0,50
South Korea Government International Bond				
0,000 % fällig am 16.09.2025 (a)		500	461	0,31
Spain Government International Bond				
2,350 % fällig am 30.07.2033		912	832	0,56
3,550 % fällig am 31.10.2033		590	595	0,40
United Kingdom Gilt				
0,875 % fällig am 31.01.2046	£	1.100	632	0,43
			14.787	10,00
		AKTIEN		
VORZUGSWERTPAPIERE				
Nationwide Building Society				
10,250 %		3.504	470	0,32
Summe Übertragbare Wertpapiere			**€ 145.291**	**98,25**
INVESTMENTFONDS				
BÖRSENGEHANDELTE FONDS				
PIMCO ETFs plc - PIMCO Euro Short Maturity UCITS ETF (d)		122.900	11.875	8,03
Summe Investmentfonds			**€ 11.875**	**8,03**

PENSIONSGESCHÄFTE

Kontrahent	Kredit-zins	Abrechnungs-datum	Fälligkeits-datum	Kapital-betrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensions-geschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensions-geschäft[1]	% des Nettovermögens
FICC	2,400 %	30.06.2023	03.07.2023	$ 322	U.S. Treasury Notes 4,625 % fällig am 30.06.2025	€ (301)	€ 295	€ 295	0,20
Summe Pensionsgeschäfte						**€ (301)**	**€ 295**	**€ 295**	**0,20**

[1] Umfasst aufgelaufene Zinsen.

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

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

FUTURES

Beschreibung	Art	Ablauf-monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Euro-Bobl September Futures	Long	09.2023	332	€ (503)	(0,34)
Euro-BTP Italy Government Bond September Futures	Short	09.2023	5	(5)	0,00
Euro-Bund 10-Year Bond September Futures	Short	09.2023	167	183	0,12
Euro-Buxl 30-Year Bond September Futures	Short	09.2023	18	(37)	(0,03)
Euro-OAT France Government 10-Year Bond September Futures	Long	09.2023	22	(2)	0,00
Euro-Schatz September Futures	Long	09.2023	196	(114)	(0,08)
U.S. Treasury 2-Year Note September Futures	Long	09.2023	64	(167)	(0,11)
U.S. Treasury 5-Year Note September Futures	Short	09.2023	183	329	0,22
U.S. Treasury 10-Year Note September Futures	Long	09.2023	151	(243)	(0,16)

Beschreibung	Art	Ablauf-monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
U.S. Treasury 10-Year Ultra September Futures	Short	09.2023	160	€ 178	0,12
U.S. Treasury 30-Year Bond September Futures	Short	09.2023	20	1	0,00
U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond September Futures	Long	09.2023	3	(1)	0,00
United Kingdom Long Gilt September Futures	Short	09.2023	8	8	0,01
				€ (373)	(0,25)

VERKAUFSOPTIONEN

OPTIONEN AUF BÖRSENGEHANDELTE TERMINKONTRAKTE

Beschreibung	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Anzahl der Kontrakte	Aufgeld	Markt-wert	% des Nettovermögens
Put - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note August Futures	$ 113,000	21.07.2023	26	€ (17)	€ (27)	(0,02)
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate					**€ (400)**	**(0,27)**

ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)

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

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES - SCHUTZKAUF[1]

Index/Tranchen	Zu bezahlender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag[3]	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
iTraxx Crossover 37 5-Year Index	(5,000) %	20.06.2027	€ 3.800	€ (238)	(0,16)
iTraxx Europe Main 39 5-Year Index	(1,000)	20.06.2028	16.800	(153)	(0,10)
				€ (391)	(0,26)

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF[2]

Index/Tranchen	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag[3]	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
CDX.IG-40 5-Year Index	1,000 %	20.06.2028	$ 1.800	€ 17	0,01

ZINSSWAPS

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fest-Zinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Erhalt[4]	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	3,250 %	20.09.2053	£ 900	€ 73	0,05
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,000	16.06.2029	¥ 888.000	(65)	(0,04)
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,435	20.06.2029	312.000	(14)	(0,01)
Zahlung[4]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,880	25.01.2052	$ 1.800	(463)	(0,31)
Erhalt[4]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,865	13.02.2054	2.700	57	0,04
Zahlung[4]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,085	13.02.2034	5.000	(81)	(0,06)
Erhalt[4]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,250	20.12.2053	3.300	(14)	(0,01)
Zahlung[4]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,500	20.12.2033	7.500	(64)	(0,04)
Erhalt[4]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	4,250	20.12.2025	11.300	62	0,04
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,880	25.07.2023	1.800	(6)	(0,01)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	0,550	10.08.2024	€ 800	(33)	(0,02)
Zahlung[4]	6-Month EUR-EURIBOR	0,819	19.12.2034	6.800	(509)	(0,34)
Zahlung[4]	6-Month EUR-EURIBOR	0,854	19.12.2039	3.300	(443)	(0,30)
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	1,700	15.03.2073	300	34	0,02
Erhalt[4]	6-Month EUR-EURIBOR	2,500	20.09.2053	5.400	(21)	(0,01)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,547	09.03.2033	700	(14)	(0,01)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,804	19.05.2033	2.700	37	0,02
Erhalt[4]	6-Month EUR-EURIBOR	3,000	20.09.2028	7.700	(27)	(0,02)
Zahlung[4]	6-Month EUR-EURIBOR	3,000	20.09.2033	17.500	(2)	0,00
Erhalt[4]	6-Month EUR-EURIBOR	3,500	20.09.2025	43.600	(22)	(0,02)
Zahlung	CPTFEMU	1,380	15.03.2031	700	(130)	(0,09)
Zahlung	CPTFEMU	3,520	15.09.2024	300	(3)	0,00
Zahlung	CPTFEMU	3,720	15.09.2024	700	(4)	0,00
Zahlung	CPTFEMU	3,850	15.09.2024	500	(3)	0,00
					€ (1.655)	(1,12)
Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate					**€ (2.029)**	**(1,37)**

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

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

(3) Der maximal mögliche Betrag, den der Fonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

(4) Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft.

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

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

VERKAUFSOPTIONEN

ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag[1]	Aufgeld	Markt-wert	% des Nettovermögens
BPS	Call - OTC 2-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,750 %	12.09.2023	9.900	€ (26)	€ (11)	(0,01)
FAR	Call - OTC 2-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	4,420	21.09.2023	9.300	(48)	(36)	(0,02)
MYC	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	0,008	17.12.2029	5.500	(342)	(141)	(0,09)
	Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Erhalt	0,008	17.12.2029	10.900	(352)	(157)	(0,11)
							€ (768)	€ (345)	(0,23)

(1) Der Nennbetrag stellt die Anzahl der Kontrakte dar.

DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2023	DKK 18.593	€ 2.497	€ 0	€ 0	€ 0	0,00
	07.2023	£ 105	123	0	0	0	0,00
	07.2023	$ 936	868	10	0	10	0,01
BPS	07.2023	€ 21.116	$ 23.142	97	(2)	95	0,06
	08.2023	$ 195	CNH 1.344	0	(8)	(8)	(0,01)
	08.2023	20.621	€ 18.793	0	(82)	(82)	(0,05)
BRC	07.2023	€ 6.035	DKK 44.940	0	0	0	0,00
	07.2023	215	£ 184	0	(1)	(1)	0,00
	07.2023	£ 3.591	€ 4.158	0	(26)	(26)	(0,02)
	08.2023	DKK 44.928	6.035	0	(1)	(1)	0,00
CBK	07.2023	€ 1.797	DKK 13.385	1	0	1	0,00
	07.2023	446	£ 381	0	(2)	(2)	0,00
	07.2023	948	$ 1.017	0	(16)	(16)	(0,01)
JPM	07.2023	DKK 62.274	€ 8.362	0	(2)	(2)	0,00
	07.2023	€ 1.233	DKK 9.183	0	0	0	0,00
	07.2023	303	¥ 45.165	0	(17)	(17)	(0,01)
	08.2023	DKK 9.180	€ 1.233	0	0	0	0,00
	08.2023	$ 156	CNH 1.079	0	(7)	(7)	0,00
	09.2023	ILS 17	$ 5	0	0	0	0,00
MBC	07.2023	€ 1.631	DKK 12.150	1	0	1	0,00
	07.2023	27.309	£ 23.580	167	0	167	0,11
	07.2023	1.188	¥ 177.526	0	(62)	(62)	(0,04)
	07.2023	778	$ 838	0	(9)	(9)	(0,01)
	07.2023	£ 11.326	€ 13.071	0	(127)	(127)	(0,09)
	07.2023	¥ 235.061	1.492	1	0	1	0,00
	08.2023	€ 1.492	¥ 234.398	0	0	0	0,00
	08.2023	£ 23.402	€ 27.071	0	(165)	(165)	(0,11)
MYI	07.2023	€ 163	DKK 1.215	0	0	0	0,00
	07.2023	1.293	$ 1.403	1	(8)	(7)	0,00
	07.2023	$ 933	€ 873	18	0	18	0,01
	09.2023	ILS 32	$ 9	0	0	0	0,00
RBC	07.2023	$ 300	€ 280	5	0	5	0,00
	08.2023	75	MXN 1.292	0	0	0	0,00
SCX	08.2023	CNH 2.952	$ 430	21	0	21	0,01
	08.2023	$ 74	CNH 511	0	(3)	(3)	0,00
SOG	07.2023	23.590	€ 21.929	307	0	307	0,21
UAG	07.2023	£ 9.236	10.618	0	(144)	(144)	(0,10)
				€ 629	€ (682)	€ (53)	(0,04)

Summe Freiverkehrsfinanzderivate	**€ (398)**	**(0,27)**
Summe Anlagen	**€ 154.634**	**104,57**
Sonstige Aktiva und Passiva	**€ (6.756)**	**(4,57)**
Nettovermögen	**€ 147.878**	**100,00**

ERLÄUTERUNGEN ZUR AUFSTELLUNG DES WERTPAPIERBESTANDS (Angaben in Tausend*):

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

^ Das Wertpapier ist in Verzug.

(a) Nullkuponwertpapier.

(b) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

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

(d) Mit dem Fonds verbunden.

(e) Bedingt wandelbares Wertpapier.

Barmittel in Höhe von 2.533 EUR (31. Dezember 2022: 3.688 EUR) wurden zum 30. Juni 2023 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Barmittel in Höhe von 9 EUR (31. Dezember 2022: 1.165 EUR) wurden zum 30. Juni 2023 gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. als Sicherheit für Finanzderivate verpfändet.

Beizulegender Zeitwert[1]

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 30. Juni 2023 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie[2]	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	€ 0	€ 145.291	€ 0	€ 145.291
Investmentfonds	0	11.875	0	11.875
Pensionsgeschäfte	0	295	0	295
Finanzderivate[3]	(470)	(2.357)	0	(2.827)
Summen	**€ (470)**	**€ 155.104**	**€ 0**	**€ 154.634**

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

Kategorie[2]	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	€ 0	€ 193.346	€ 0	€ 193.346
Investmentfonds	18.800	0	0	18.800
Pensionsgeschäfte	0	4.400	0	4.400
Finanzderivate[3]	731	(1.267)	0	(536)
Summen	**€ 19.531**	**€ 196.479**	**€ 0**	**€ 216.010**

(1) Weitere Informationen finden Sie in den Erläuterungen in Erläuterung 3.

(2) Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung des Wertpapierbestands.

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

Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC-Finanzderivate und -Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2023 und 31. Dezember 2022:

	Zum 30. Jun. 2023			Zum 31. Dez. 2022		
Kontrahent	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-Engagement[1]	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-Engagement[1]
AZD	€ k. A.	€ k. A.	€ k. A.	€ 3	€ 0	€ 3
BOA	10	0	10	(9)	(440)	(449)
BPS	(6)	0	(6)	(397)	360	(37)
BRC	(28)	0	(28)	(93)	0	(93)
CBK	(17)	0	(17)	(65)	290	225
CLY	k. A.	k. A.	k. A.	1	0	1
FAR	(36)	0	(36)	k. A.	k. A.	k. A.
GLM	0	(165)	(165)	(80)	(169)	(249)
GST	k. A.	k. A.	k. A.	(312)	253	(59)
JPM	(26)	9	(17)	(326)	262	(64)
MBC	(194)	0	(194)	(27)	0	(27)
MYC	(298)	(247)	(545)	(309)	(253)	(562)
MYI	11	0	11	(18)	0	(18)
RBC	5	0	5	k. A.	k. A.	k. A.
RYL	k. A.	k. A.	k. A.	6	0	6
SCX	18	0	18	6	0	6
SSB	k. A.	k. A.	k. A.	391	(328)	63
SOG	307	(412)	(105)	k. A.	k. A.	k. A.
UAG	(144)	0	(144)	k. A.	k. A.	k. A.

(1) Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären.

Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung des Wertpapierbestands zum 30. Juni 2023:

	30. Jun. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	87,93	78,37
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	10,30	13,20
Sonstige übertragbare Wertpapiere	0,02	k. A.
Investmentfonds	8,03	8,90
Pensionsgeschäfte	0,20	2,08
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	(0,27)	0,34
Zentral abgerechnete Finanzderivate	(1,37)	(0,02)
Freiverkehrsfinanzderivate	(0,27)	(0,58)

Das Anlageportfolio des Fonds konzentriert sich zum 30. Juni 2023 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	30. Jun. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
Unternehmensanleihen und Wechsel	30,04	39,32
US-Regierungsbehörden	9,05	5,19
US-Schatzobligationen	8,22	2,49
Non-Agency-MBS	18,89	14,49
Forderungsbesicherte Wertpapiere	21,73	15,94
Staatsemissionen	10,00	7,09
Vorzugswertpapiere	0,32	0,30
Kurzfristige Instrumente	k. A.	6,75
Investmentfonds	8,03	8,90
Pensionsgeschäfte	0,20	2,08
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	(0,25)	0,34
Verkaufsoptionen		
Optionen auf börsengehandelte Terminkontrakte	(0,02)	k. A.
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzkauf	(0,26)	(0,21)
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzverkauf	0,01	0,01
Zinsswaps	(1,12)	0,18
Freiverkehrsfinanzderivate		
Optionskauf		
Zinsswapoptionen	k. A.	0,48
Verkaufsoptionen		
Zinsswapoptionen	(0,23)	(1,25)
Devisenterminkontrakte	(0,04)	0,19
Sonstige Aktiva und Passiva	(4,57)	(2,29)
Nettovermögen	100,00	100,00

BESCHREIBUNG		PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE				
ARGENTINIEN				
STAATSEMISSIONEN				
Argentina Government International Bond				
0,500 % fällig am 09.07.2030	$	254	$ 77	0,01
1,000 % fällig am 09.07.2029		3	1	0,00
1,500 % fällig am 09.07.2035		91	26	0,01
Summe Argentinien			104	0,02
AUSTRALIEN				
NON-AGENCY-MBS				
RESIMAC Bastille Trust				
6,093 % fällig am 05.09.2057		71	72	0,02
STAATSEMISSIONEN				
Australia Government International Bond				
0,500 % fällig am 21.09.2026	AUD	4.100	2.442	0,59
0,750 % fällig am 21.11.2027		2.512	1.624	0,40
1,000 % fällig am 21.12.2030		700	377	0,09
1,250 % fällig am 21.05.2032		500	265	0,06
1,750 % fällig am 21.06.2051		700	271	0,07
2,500 % fällig am 21.05.2030		500	303	0,07
4,500 % fällig am 21.04.2033		2.100	1.451	0,35
			6.733	1,63
Summe Australien			6.805	1,65
BRASILIEN				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Odebrecht Oil & Gas Finance Ltd.				
0,000 % fällig am 31.07.2023 (c)(f)	$	254	1	0,00
Swiss Insured Brazil Power Finance SARL				
9,850 % fällig am 16.07.2032	BRL	14.760	2.822	0,69
Summe Brasilien			2.823	0,69
BULGARIEN				
STAATSEMISSIONEN				
Bulgaria Government International Bond				
4,500 % fällig am 27.01.2033	€	2.100	2.274	0,55
KANADA				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Air Canada Pass-Through Trust				
3,300 % fällig am 15.07.2031	$	385	341	0,08
Fairfax Financial Holdings Ltd.				
2,750 % fällig am 29.03.2028	€	500	492	0,12
			833	0,20
STAATSEMISSIONEN				
Canadian Government Real Return Bond				
1,500 % fällig am 01.12.2044 (e)	CAD	2.570	1.943	0,47
Summe Kanada			2.776	0,67
CAYMAN INSELN				
FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE				
Atlas Senior Loan Fund Ltd.				
6,350 % fällig am 15.01.2031	$	1.014	1.001	0,24
6,410 % fällig am 16.01.2030		975	970	0,24
Babson CLO Ltd.				
6,240 % fällig am 20.01.2031		1.174	1.164	0,28
Bain Capital Credit CLO				
6,233 % fällig am 23.04.2031		1.200	1.192	0,29
CBAM Ltd.				
6,280 % fällig am 17.04.2031		1.300	1.285	0,31
CIFC Funding Ltd.				
6,262 % fällig am 18.04.2031		1.500	1.487	0,36
Dryden CLO Ltd.				
6,280 % fällig am 15.04.2031		1.400	1.388	0,34
Dryden Senior Loan Fund				
6,521 % fällig am 15.08.2030		1.227	1.223	0,30
Gallatin CLO Ltd.				
6,311 % fällig am 21.01.2028		261	261	0,06
LCM LP				
6,290 % fällig am 20.07.2031		1.300	1.287	0,31
OCP CLO Ltd.				
6,370 % fällig am 20.07.2029	$	1.038	$ 1.032	0,25
Octagon Investment Partners Ltd.				
6,220 % fällig am 16.04.2031		1.100	1.089	0,27
Octagon Loan Funding Ltd.				
6,525 % fällig am 18.11.2031		1.300	1.288	0,31
Venture CLO Ltd.				
6,140 % fällig am 15.04.2027		194	194	0,05
6,300 % fällig am 20.07.2030		1.253	1.241	0,30
6,350 % fällig am 20.01.2029		859	853	0,21
Wind River CLO Ltd.				
6,312 % fällig am 18.07.2031		1.295	1.280	0,31
			18.235	4,43
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Gaci First Investment Co.				
4,750 % fällig am 14.02.2030		1.400	1.380	0,34
4,875 % fällig am 14.02.2035		1.500	1.440	0,35
5,125 % fällig am 14.02.2053		700	631	0,15
KSA Sukuk Ltd.				
5,268 % fällig am 25.10.2028		400	409	0,10
QNB Finance Ltd.				
1,375 % fällig am 26.01.2026		400	363	0,09
Sands China Ltd.				
4,300 % fällig am 08.01.2026		200	188	0,05
5,625 % fällig am 08.08.2025		400	390	0,09
			4.801	1,17
Summe Cayman Inseln			23.036	5,60
CHILE				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Banco Santander Chile				
2,700 % fällig am 10.01.2025		1.100	1.052	0,26
STAATSEMISSIONEN				
Bonos de la Tesoreria de la Republica en Pesos				
4,500 % fällig am 01.03.2026	CLP	1.120.000	1.359	0,33
Summe Chile			2.411	0,59
CHINA				
STAATSEMISSIONEN				
China Government International Bond				
3,190 % fällig am 15.04.2053	CN Y	2.000	285	0,07
KOLUMBIEN				
STAATSEMISSIONEN				
Colombia Government International Bond				
7,500 % fällig am 02.02.2034	$	1.900	1.863	0,45
Colombian TES				
5,750 % fällig am 03.11.2027	COP	570.000	117	0,03
Summe Kolumbien			1.980	0,48
TSCHECHISCHE REPUBLIK				
STAATSEMISSIONEN				
Czech Republic Government International Bond				
0,950 % fällig am 15.05.2030	CZK	12.100	444	0,11
DÄNEMARK				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Jyske Realkredit A/S				
1,000 % fällig am 01.10.2050	DKK	18.651	1.923	0,47
1,500 % fällig am 01.10.2037		0	0	0,00
1,500 % fällig am 01.07.2050		0	0	0,00
1,500 % fällig am 01.10.2050		0	0	0,00
1,500 % fällig am 01.10.2053		1.155	127	0,03
2,000 % fällig am 01.10.2047		0	0	0,00
Nordea Kredit Realkreditaktieselskab				
1,000 % fällig am 01.10.2050		44.431	4.414	1,07
1,500 % fällig am 01.10.2037		0	0	0,00
1,500 % fällig am 01.10.2050		0	0	0,00
1,500 % fällig am 01.10.2053		385	43	0,01
2,000 % fällig am 01.10.2047		0	0	0,00
2,000 % fällig am 01.10.2050		0	0	0,00
2,500 % fällig am 01.10.2047		0	0	0,00
Nykredit Realkredit A/S				
1,000 % fällig am 01.10.2050	DKK	23.547	$ 2.426	0,59
1,000 % fällig am 01.10.2053		0	0	0,00
1,500 % fällig am 01.10.2037		0	0	0,00
1,500 % fällig am 01.10.2050		0	0	0,00
1,500 % fällig am 01.10.2053		10.576	1.105	0,27
2,000 % fällig am 01.10.2047		0	0	0,00
2,500 % fällig am 01.10.2036		0	0	0,00
2,500 % fällig am 01.10.2047		0	0	0,00
3,000 % fällig am 01.10.2047		0	0	0,00
Realkredit Danmark A/S				
1,000 % fällig am 01.10.2050		3.610	380	0,09
1,500 % fällig am 01.10.2053		3.326	356	0,09
2,500 % fällig am 01.04.2036		0	0	0,00
2,500 % fällig am 01.04.2047		0	0	0,00
Summe Dänemark			10.774	2,62
DOMINIKANISCHE REPUBLIK				
STAATSEMISSIONEN				
Dominican Republic Government International Bond				
6,500 % fällig am 15.02.2048	$	800	693	0,17
FRANKREICH				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
BNP Paribas S.A.				
3,800 % fällig am 10.01.2024		300	296	0,07
Societe Generale S.A.				
1,488 % fällig am 14.12.2026		3.700	3.258	0,79
6,446 % fällig am 10.01.2029		900	902	0,22
6,691 % fällig am 10.01.2034		1.000	1.019	0,25
			5.475	1,33
STAATSEMISSIONEN				
France Government International Bond				
0,100 % fällig am 25.07.2031 (e)	€	1.754	1.861	0,45
0,250 % fällig am 25.07.2024 (e)		1.867	2.018	0,49
0,500 % fällig am 25.05.2072		100	43	0,01
0,750 % fällig am 25.05.2052		3.550	2.112	0,51
1,500 % fällig am 25.05.2050		200	152	0,04
3,000 % fällig am 25.05.2054		400	413	0,10
3,250 % fällig am 25.05.2045		200	219	0,06
			6.818	1,66
Summe Frankreich			12.293	2,99
DEUTSCHLAND				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Deutsche Bank AG				
0,050 % fällig am 20.11.2024		3.800	3.923	0,95
1,375 % fällig am 03.09.2026		400	401	0,10
1,375 % fällig am 17.02.2032		400	324	0,08
1,625 % fällig am 20.01.2027		2.500	2.426	0,59
1,750 % fällig am 19.11.2030		400	345	0,08
2,625 % fällig am 12.02.2026		500	516	0,13
3,035 % fällig am 28.05.2032 (i)	$	1.050	828	0,20
Summe Deutschland			8.763	2,13
GUATEMALA				
STAATSEMISSIONEN				
Guatemala Government International Bond				
5,375 % fällig am 24.04.2032		400	381	0,09
HONGKONG				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Huarong Finance Co. Ltd.				
2,125 % fällig am 30.09.2023		400	395	0,10
UNGARN				
STAATSEMISSIONEN				
Hungary Government International Bond				
5,000 % fällig am 22.02.2027	€	100	110	0,03
6,250 % fällig am 22.09.2032	$	1.500	1.540	0,37
6,750 % fällig am 25.09.2052		500	517	0,13
Magyar Export-Import Bank				
6,125 % fällig am 04.12.2027		2.100	2.080	0,50
Summe Ungarn			4.247	1,03

BESCHREIBUNG		PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
INDONESIEN				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Perusahaan Perseroan Persero PT Perusahaan Listrik Negara				
3,000 % fällig am 30.06.2030	$	3.500	$ 2.997	0,73
STAATSEMISSIONEN				
Indonesia Government International Bond				
8,375 % fällig am 15.03.2034	IDR	22.982.000	1.765	0,43
Summe Indonesien			4.762	1,16
IRLAND				
FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE				
Accunia European CLO DAC				
4,127 % fällig am 15.07.2030	€	426	459	0,11
Ares European CLO DAC				
3,957 % fällig am 15.10.2031		1.100	1.180	0,29
Armada Euro CLO DAC				
3,897 % fällig am 15.07.2031		400	427	0,10
Aurium CLO DAC				
3,907 % fällig am 16.01.2031		1.098	1.175	0,29
BNPP AM Euro CLO DAC				
4,031 % fällig am 22.07.2032		1.000	1.066	0,26
Cairn CLO DAC				
3,842 % fällig am 30.04.2031		394	422	0,10
Carlyle Euro CLO DAC				
3,877 % fällig am 15.01.2031		996	1.063	0,26
Dryden Euro CLO DAC				
3,837 % fällig am 15.04.2033		700	747	0,18
4,183 % fällig am 15.05.2034		1.000	1.068	0,26
GoldenTree Loan Management EUR CLO DAC				
4,100 % fällig am 20.01.2032		1.000	1.064	0,26
Harvest CLO DAC				
3,880 % fällig am 20.10.2031		800	855	0,21
3,937 % fällig am 15.07.2031		1.100	1.171	0,28
4,027 % fällig am 15.01.2032		1.100	1.174	0,29
4,250 % fällig am 26.06.2030		975	1.042	0,25
Jubilee CLO DAC				
3,777 % fällig am 15.04.2030		600	639	0,16
3,827 % fällig am 15.04.2031		400	426	0,10
Madison Park Euro Funding DAC				
3,977 % fällig am 15.07.2032		1.100	1.170	0,28
Man GLG Euro CLO DAC				
3,987 % fällig am 15.10.2032		1.099	1.168	0,28
4,216 % fällig am 15.12.2031		599	642	0,16
Oak Hill European Credit Partners DAC				
3,940 % fällig am 20.10.2031		1.100	1.169	0,28
OCP Euro CLO DAC				
4,091 % fällig am 22.09.2034		800	850	0,21
Palmer Square European Loan Funding DAC				
3,907 % fällig am 15.07.2031		963	1.026	0,25
Sculptor European CLO DAC				
3,916 % fällig am 14.01.2032		1.100	1.179	0,29
			21.182	5,15
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
AerCap Ireland Capital DAC				
2,450 % fällig am 29.10.2026	$	400	357	0,09
3,000 % fällig am 29.10.2028		500	433	0,10
			790	0,19
Summe Irland			21.972	5,34
ISRAEL				
STAATSEMISSIONEN				
Israel Government International Bond				
1,500 % fällig am 30.11.2023	ILS	6.000	1.596	0,39
1,750 % fällig am 31.08.2025		2.100	537	0,13
2,000 % fällig am 31.03.2027		2.700	681	0,16
4,500 % fällig am 17.01.2033	$	2.200	2.169	0,53
Summe Israel			4.983	1,21
ITALIEN				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
AMCO - Asset Management Co. SpA				
1,500 % fällig am 17.07.2023	€	389	424	0,10
4,625 % fällig am 06.02.2027		600	651	0,16
Banca Monte dei Paschi di Siena SpA				
0,875 % fällig am 08.10.2027	€	1.300	$ 1.266	0,31
UniCredit SpA				
7,830 % fällig am 04.12.2023	$	1.100	1.107	0,27
			3.448	0,84
STAATSEMISSIONEN				
Cassa Depositi e Prestiti SpA				
5,750 % fällig am 05.05.2026		600	593	0,14
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro				
2,350 % fällig am 15.09.2024 (e)	€	23.519	25.825	6,28
Italy Government International Bond				
6,000 % fällig am 04.08.2028	£	1.000	1.241	0,30
			27.659	6,72
Summe Italien			31.107	7,56
ELFENBEINKÜSTE				
STAATSEMISSIONEN				
Ivory Coast Government International Bond				
5,250 % fällig am 22.03.2030	€	1.600	1.480	0,36
5,875 % fällig am 17.10.2031		700	641	0,15
Summe Elfenbeinküste			2.121	0,51
JAPAN				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Nomura Holdings, Inc.				
2,329 % fällig am 22.01.2027	$	400	354	0,09
Sumitomo Mitsui Banking Corp.				
0,409 % fällig am 07.11.2029	€	1.300	1.157	0,28
Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc.				
5,520 % fällig am 13.01.2028	$	1.200	1.206	0,29
Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd.				
0,010 % fällig am 15.10.2027	€	1.000	927	0,22
			3.644	0,88
STAATSEMISSIONEN				
Japan Government International Bond				
0,005 % fällig am 01.10.2024	¥	1.050.000	7.277	1,77
0,100 % fällig am 10.03.2028 (e)		893.665	6.517	1,58
0,100 % fällig am 10.03.2029 (e)		527.015	3.860	0,94
0,500 % fällig am 20.03.2049		238.000	1.395	0,34
0,700 % fällig am 20.06.2051		254.000	1.530	0,37
			20.579	5,00
Summe Japan			24.223	5,88
KASACHSTAN				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
KazMunayGas National Co. JSC				
3,500 % fällig am 14.04.2033	$	1.550	1.204	0,29
5,750 % fällig am 19.04.2047		200	163	0,04
6,375 % fällig am 24.10.2048		400	343	0,09
Summe Kasachstan			1.710	0,42
		AKTIEN		
LUXEMBURG				
STAMMAKTIEN				
DrillCo Holding Lux S.A. (b)		6.700	129	0,03
DrillCo Holding Lux S.A. (b)(i)		16.048	308	0,08
Summe Stammaktien			437	0,11
		PAR (000S)		
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Aroundtown S.A.				
0,375 % fällig am 15.04.2027	€	700	550	0,13
CBRE Global Investors Open-Ended Fund S.C.A. SICAV-SIF Pan European Core Fund				
0,900 % fällig am 12.10.2029		300	240	0,06
CPI Property Group S.A.				
1,625 % fällig am 23.04.2027		700	558	0,13
1,750 % fällig am 14.01.2030	€	300	$ 199	0,05
FORESEA Holding S.A.				
7,500 % fällig am 15.06.2030	$	284	250	0,06
Logicor Financing SARL				
0,625 % fällig am 17.11.2025	€	200	191	0,05
0,750 % fällig am 15.07.2024		600	624	0,15
TMS Issuer SARL				
5,780 % fällig am 23.08.2032	$	800	825	0,20
			3.437	0,83
NON-AGENCY-MBS				
Miravet SARL				
4,265 % fällig am 26.05.2065	€	485	521	0,13
Summe Luxemburg			4.395	1,07
MALAYSIA				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Petronas Capital Ltd.				
2,480 % fällig am 28.01.2032	$	500	418	0,10
3,500 % fällig am 21.04.2030		200	185	0,05
4,550 % fällig am 21.04.2050		200	184	0,04
4,800 % fällig am 21.04.2060		200	188	0,05
Summe Malaysia			975	0,24
MULTINATIONAL				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Preferred Term Securities Ltd.				
5,914 % fällig am 23.06.2035		1.056	992	0,24
NIEDERLANDE				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Cooperatieve Rabobank UA				
3,758 % fällig am 06.04.2033		400	348	0,08
CTP NV				
0,500 % fällig am 21.06.2025	€	1.100	1.070	0,26
ING Groep NV				
2,125 % fällig am 23.05.2026		500	520	0,13
Prosus NV				
1,207 % fällig am 19.01.2026		1.500	1.491	0,36
3,257 % fällig am 19.01.2027	$	1.600	1.447	0,35
			4.876	1,18
NON-AGENCY-MBS				
Jubilee Place BV				
4,177 % fällig am 17.10.2057	€	443	484	0,12
Summe Niederlande			5.360	1,30
NEUSEELAND				
STAATSEMISSIONEN				
New Zealand Government International Bond				
1,500 % fällig am 15.05.2031	NZD	600	294	0,07
NORWEGEN				
STAATSEMISSIONEN				
Kommunalbanken A/S				
1,900 % fällig am 19.01.2027	AUD	400	242	0,06
Norway Government International Bond				
1,750 % fällig am 13.03.2025	NOK	6.000	539	0,13
Summe Norwegen			781	0,19
PERU				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Banco de Credito del Peru S.A.				
4,650 % fällig am 17.09.2024	PEN	1.700	449	0,11
STAATSEMISSIONEN				
Peru Government International Bond				
8,200 % fällig am 12.08.2026		2.100	616	0,15
Summe Peru			1.065	0,26

BESCHREIBUNG		PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
PHILIPPINEN				
STAATSEMISSIONEN				
Philippines Government International Bond				
6,250 % fällig am 14.01.2036	PHP	21.000	$ 379	0,09
POLEN				
STAATSEMISSIONEN				
Poland Government International Bond				
3,875 % fällig am 14.02.2033	€	1.300	1.409	0,34
4,250 % fällig am 14.02.2043		900	966	0,23
4,875 % fällig am 04.10.2033	$	400	393	0,10
5,500 % fällig am 16.11.2027		100	103	0,03
5,500 % fällig am 04.04.2053		300	303	0,07
Summe Polen			3.174	0,77
PORTUGAL				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Banco Espirito Santo S.A.				
4,000 % fällig am 21.01.2019 ^	€	1.900	508	0,12
4,750 % fällig am 15.01.2018 ^		600	160	0,04
Summe Portugal			668	0,16
KATAR				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
QatarEnergy				
2,250 % fällig am 12.07.2031	$	200	168	0,04
3,300 % fällig am 12.07.2051		200	147	0,04
Summe Katar			315	0,08
RUMÄNIEN				
STAATSEMISSIONEN				
Romania Government International Bond				
1,375 % fällig am 02.12.2029	€	360	305	0,08
1,750 % fällig am 13.07.2030		1.300	1.085	0,26
2,000 % fällig am 28.01.2032		100	80	0,02
2,000 % fällig am 14.04.2033		800	618	0,15
2,124 % fällig am 16.07.2031		300	249	0,06
2,625 % fällig am 02.12.2040		100	67	0,02
2,750 % fällig am 14.04.2041		200	134	0,03
2,875 % fällig am 13.04.2042		500	336	0,08
6,625 % fällig am 27.09.2029		800	909	0,22
Summe Rumänien			3.783	0,92
RUSSLAND				
STAATSEMISSIONEN				
Russia Government International Bond				
1,125 % fällig am 20.11.2027 ^		2.000	1.025	0,25
4,750 % fällig am 27.05.2026 ^	$	200	101	0,03
7,700 % fällig am 23.03.2033 ^	RUB	33.500	135	0,03
Summe Russland			1.261	0,31
SAUDI-ARABIEN				
STAATSEMISSIONEN				
Saudi Arabia Government International Bond				
3,250 % fällig am 22.10.2030	$	200	182	0,04
4,750 % fällig am 18.01.2028		1.200	1.191	0,29
4,875 % fällig am 18.07.2033		1.300	1.300	0,32
5,000 % fällig am 18.01.2053		900	835	0,20
Summe Saudi-Arabien			3.508	0,85
SERBIEN				
STAATSEMISSIONEN				
Serbia Government International Bond				
2,050 % fällig am 23.09.2036	€	400	268	0,06
3,125 % fällig am 15.05.2027		2.500	2.454	0,60
Summe Serbien			2.722	0,66
SINGAPUR				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
CapitaLand Ascendas REIT				
0,750 % fällig am 23.06.2028		1.000	873	0,21
Pfizer Investment Enterprises Pte. Ltd.				
4,650 % fällig am 19.05.2030	$	400	396	0,10
Summe Singapur			1.269	0,31

BESCHREIBUNG		PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
SLOWENIEN				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Nova Kreditna Banka Maribor d.d.				
1,875 % fällig am 27.01.2025	€	400	$ 422	0,10
Nova Ljubljanska Banka d.d.				
3,400 % fällig am 05.02.2030		400	371	0,09
Summe Slowenien			793	0,19
SÜDAFRIKA				
STAATSEMISSIONEN				
South Africa Government International Bond				
5,375 % fällig am 24.07.2044	$	300	214	0,05
5,750 % fällig am 30.09.2049		200	142	0,04
Summe Südafrika			356	0,09
SÜDKOREA				
STAATSEMISSIONEN				
South Korea Government International Bond				
2,000 % fällig am 10.06.2031	KRW	1.018.830	686	0,16
2,125 % fällig am 10.06.2027		680.000	487	0,12
2,375 % fällig am 10.12.2028		2.960.000	2.103	0,51
3,250 % fällig am 10.06.2033		1.728.590	1.268	0,31
4,250 % fällig am 10.12.2032		4.950.810	3.926	0,95
5,500 % fällig am 10.03.2028		640.000	524	0,13
Summe Südkorea			8.994	2,18
SPANIEN				
FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE				
BBVA Consumer Auto				
0,270 % fällig am 20.07.2031	€	145	154	0,04
Banco Santander S.A.				
1,849 % fällig am 25.03.2026	$	200	179	0,04
3,496 % fällig am 24.03.2025		800	767	0,19
CaixaBank S.A.				
1,750 % fällig am 24.10.2023	€	600	650	0,16
			1.596	0,39
STAATSEMISSIONEN				
Autonomous Community of Catalonia				
4,220 % fällig am 26.04.2035		300	325	0,08
Spain Government International Bond				
1,450 % fällig am 31.10.2071		500	264	0,06
3,450 % fällig am 30.07.2066		2.000	1.990	0,48
			2.579	0,62
Summe Spanien			4.329	1,05
SUPRANATIONAL				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Asian Development Bank				
6,150 % fällig am 25.02.2030	INR	252.300	2.972	0,72
SCHWEIZ				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Credit Suisse AG				
6,500 % fällig am 08.08.2023 (h)	$	1.400	1.395	0,34
UBS Group AG				
4,125 % fällig am 24.09.2025		200	191	0,05
6,373 % fällig am 15.07.2026		500	497	0,12
6,537 % fällig am 12.08.2033		300	307	0,07
7,000 % fällig am 30.09.2027	£	300	376	0,09
7,375 % fällig am 07.09.2033		200	267	0,06
7,750 % fällig am 01.03.2029	€	1.900	2.299	0,56
9,016 % fällig am 15.11.2033	$	500	600	0,15
Summe Schweiz			5.932	1,44
VEREINIGTE ARABISCHE EMIRATE				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
MDGH GMTN RSC Ltd.				
5,500 % fällig am 28.04.2033		200	211	0,05

BESCHREIBUNG		PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
GROSSBRITANNIEN				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Antofagasta PLC				
2,375 % fällig am 14.10.2030	$	400	$ 326	0,08
Barclays PLC				
6,224 % fällig am 09.05.2034		600	598	0,14
7,437 % fällig am 02.11.2033		300	325	0,08
Haleon UK Capital PLC				
3,125 % fällig am 24.03.2025		700	669	0,16
HSBC Holdings PLC				
2,251 % fällig am 22.11.2027		400	355	0,09
4,041 % fällig am 13.03.2028		200	188	0,05
4,583 % fällig am 19.06.2029		1.000	942	0,23
Nationwide Building Society				
2,972 % fällig am 16.02.2028		1.300	1.169	0,28
NatWest Group PLC				
5,076 % fällig am 27.01.2030		1.100	1.050	0,25
Santander UK Group Holdings PLC				
2,469 % fällig am 11.01.2028		500	437	0,11
6,534 % fällig am 10.01.2029		1.300	1.310	0,32
Standard Chartered PLC				
0,991 % fällig am 12.01.2025		800	776	0,19
2,608 % fällig am 12.01.2028		600	532	0,13
2,678 % fällig am 29.06.2032		400	314	0,08
2,819 % fällig am 30.01.2026		400	377	0,09
TP ICAP Finance PLC				
2,625 % fällig am 18.11.2028	£	400	376	0,09
			9.744	2,37
NON-AGENCY-MBS				
Alba PLC				
5,191 % fällig am 17.03.2039		854	1.044	0,25
Avon Finance PLC				
5,809 % fällig am 20.09.2048		539	685	0,17
Canada Square Funding PLC				
5,682 % fällig am 17.06.2058		623	787	0,19
Eurosail PLC				
3,629 % fällig am 13.03.2045	€	10	10	0,00
5,140 % fällig am 13.03.2045	£	195	246	0,06
Great Hall Mortgages PLC				
5,152 % fällig am 18.03.2039		18	23	0,01
5,166 % fällig am 18.06.2039		169	212	0,05
5,644 % fällig am 18.06.2039	$	115	114	0,03
Paragon Mortgages PLC				
5,752 % fällig am 15.05.2045	£	135	171	0,04
Polaris PLC				
5,631 % fällig am 23.12.2058		668	845	0,21
Resloc UK PLC				
5,161 % fällig am 15.12.2043		474	581	0,14
Ripon Mortgages PLC				
5,491 % fällig am 28.08.2056		2.983	3.779	0,92
RMAC Securities PLC				
5,154 % fällig am 12.06.2044		549	668	0,16
Stratton Mortgage Funding PLC				
5,391 % fällig am 20.07.2060		1.237	1.572	0,38
5,765 % fällig am 12.03.2052		566	717	0,17
5,792 % fällig am 25.09.2051		889	1.128	0,27
Towd Point Mortgage Funding PLC				
5,841 % fällig am 20.07.2045		940	1.196	0,29
Trinity Square PLC				
5,316 % fällig am 15.07.2059		573	728	0,18
			14.506	3,52
STAATSEMISSIONEN				
United Kingdom Gilt				
0,125 % fällig am 22.03.2024 (e)		5.533	6.900	1,68
0,125 % fällig am 22.03.2051 (e)		291	295	0,07
0,125 % fällig am 22.03.2068 (e)		164	166	0,04
0,625 % fällig am 22.11.2042 (e)		175	212	0,05
0,625 % fällig am 22.10.2050		1.300	672	0,16
1,250 % fällig am 31.07.2051		370	233	0,06
1,500 % fällig am 31.07.2053		300	199	0,05
			8.677	2,11
Summe Großbritannien			32.927	8,00

BESCHREIBUNG		PAR (000S)		MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
USA					
FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE					
ACE Securities Corp. Home Equity Loan Trust					
5,430 % fällig am 25.07.2036	$	90	$	69	0,02
5,750 % fällig am 25.02.2036		123		120	0,03
5,810 % fällig am 25.11.2035		194		195	0,05
Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust					
4,037 % fällig am 25.07.2036		11		11	0,00
Carrington Mortgage Loan Trust					
5,370 % fällig am 25.01.2037		1.100		813	0,20
Citigroup Mortgage Loan Trust					
4,277 % fällig am 25.10.2037		533		487	0,12
5,670 % fällig am 25.03.2036		1.049		937	0,23
Countrywide Asset-Backed Certificates Trust					
5,290 % fällig am 25.08.2037 ^		784		690	0,17
5,290 % fällig am 25.06.2047 ^		238		212	0,05
5,350 % fällig am 25.06.2047 ^		988		855	0,21
5,380 % fällig am 25.04.2047		1.300		1.183	0,29
5,670 % fällig am 25.12.2036 ^		2.985		2.797	0,68
First Franklin Mortgage Loan Trust					
5,870 % fällig am 25.11.2035		101		93	0,02
First NLC Trust					
5,220 % fällig am 25.08.2037		388		199	0,05
GSAMP Trust					
5,300 % fällig am 25.12.2046		185		93	0,02
5,380 % fällig am 25.12.2046		92		46	0,01
5,630 % fällig am 25.09.2036		3.078		1.120	0,27
Home Equity Asset Trust					
6,245 % fällig am 25.05.2035		426		419	0,10
HSI Asset Securitization Corp. Trust					
5,490 % fällig am 25.12.2036		201		54	0,01
5,765 % fällig am 25.01.2036		2.300		2.097	0,51
Long Beach Mortgage Loan Trust					
5,795 % fällig am 25.11.2035		38		38	0,01
Massachusetts Educational Financing Authority					
6,205 % fällig am 25.04.2038		32		32	0,01
MASTR Asset-Backed Securities Trust					
5,360 % fällig am 25.05.2037		283		267	0,07
5,450 % fällig am 25.08.2036		283		111	0,03
5,630 % fällig am 25.06.2036		3.598		1.375	0,33
Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust					
5,280 % fällig am 25.10.2036		654		578	0,14
5,280 % fällig am 25.01.2037		1.913		877	0,21
5,400 % fällig am 25.03.2037		696		308	0,08
5,630 % fällig am 25.06.2036		1.341		709	0,17
New Century Home Equity Loan Trust					
5,870 % fällig am 25.03.2035		377		363	0,09
NovaStar Mortgage Funding Trust					
5,450 % fällig am 25.09.2036		198		86	0,02
Option One Mortgage Loan Trust					
5,290 % fällig am 25.03.2037		320		287	0,07
RAAC Trust					
6,650 % fällig am 25.09.2047		396		378	0,09
Residential Asset Mortgage Products Trust					
5,790 % fällig am 25.01.2036		338		302	0,07
6,200 % fällig am 25.09.2035		1.300		1.101	0,27
Residential Asset Securities Corp. Trust					
5,710 % fällig am 25.04.2036		56		54	0,01
Securitized Asset-Backed Receivables LLC Trust					
5,650 % fällig am 25.05.2036		407		219	0,05
5,810 % fällig am 25.08.2035 ^		609		470	0,11
6,110 % fällig am 25.01.2036 ^		32		28	0,01
Soundview Home Loan Trust					
5,710 % fällig am 25.05.2036		526		502	0,12
Structured Asset Investment Loan Trust					
5,300 % fällig am 25.09.2036		25		24	0,01
5,770 % fällig am 25.01.2036		1.963		1.808	0,44
6,200 % fällig am 25.08.2033		9		9	0,00
				22.416	5,45
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL					
7-Eleven, Inc.					
0,800 % fällig am 10.02.2024		100		97	0,02
American Tower Corp.					
3,800 % fällig am 15.08.2029		500		457	0,11
Bank of America Corp.					
1,949 % fällig am 27.10.2026	€	700	$	719	0,18
3,384 % fällig am 02.04.2026	$	600		575	0,14
4,412 % fällig am 24.08.2025	€	600		657	0,16
Bayer U.S. Finance LLC					
4,250 % fällig am 15.12.2025	$	400		386	0,09
6,562 % fällig am 15.12.2023		900		899	0,22
Broadcom, Inc.					
2,450 % fällig am 15.02.2031		500		407	0,10
Charter Communications Operating LLC					
2,250 % fällig am 15.01.2029		300		250	0,06
3,950 % fällig am 30.06.2062		800		493	0,12
5,125 % fällig am 01.07.2049		500		394	0,10
Credit Suisse AG AT1 Claim ^		300		12	0,00
Doctors Co. An Interinsurance Exchange					
4,500 % fällig am 18.01.2032		100		79	0,02
Ford Motor Credit Co. LLC					
2,748 % fällig am 14.06.2024	£	100		122	0,03
3,375 % fällig am 13.11.2025	$	500		465	0,11
3,664 % fällig am 08.09.2024		200		193	0,05
5,125 % fällig am 16.06.2025		500		487	0,12
GA Global Funding Trust					
2,250 % fällig am 06.01.2027		300		266	0,07
Goldman Sachs Group, Inc.					
3,615 % fällig am 15.03.2028		100		94	0,02
3,750 % fällig am 30.04.2024	€	800		873	0,21
4,281 % fällig am 07.02.2025		500		548	0,13
Hyatt Hotels Corp.					
1,300 % fällig am 01.10.2023	$	300		297	0,07
JPMorgan Chase & Co.					
2,595 % fällig am 24.02.2026		1.300		1.233	0,30
4,080 % fällig am 26.04.2026		1.300		1.264	0,31
Morgan Stanley					
2,103 % fällig am 08.05.2026	€	1.000		1.042	0,25
Organon & Co.					
2,875 % fällig am 30.04.2028		100		95	0,02
Pacific Gas & Electric Co.					
2,100 % fällig am 01.08.2027	$	100		86	0,02
3,150 % fällig am 01.01.2026		100		93	0,02
3,450 % fällig am 01.07.2025		100		94	0,02
3,950 % fällig am 01.12.2047 ^		100		68	0,02
4,000 % fällig am 01.12.2046 ^		100		67	0,02
4,500 % fällig am 01.07.2040		100		78	0,02
4,550 % fällig am 01.07.2030		100		91	0,02
Penske Truck Leasing Co. LP					
3,950 % fällig am 10.03.2025		1.400		1.346	0,33
Principal Life Global Funding					
1,375 % fällig am 10.01.2025		300		280	0,07
Rio Oil Finance Trust					
9,250 % fällig am 06.07.2024		334		338	0,08
Southern California Edison Co.					
1,100 % fällig am 01.04.2024		300		290	0,07
				15.235	3,70
KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG					
CenturyLink, Inc.					
7,467 % fällig am 15.03.2027		595		461	0,11
KOMMUNALANLEIHEN UND WECHSEL					
Texas Natural Gas Securitization Finance Corp. Revenue Bonds, Series 2023					
5,102 % fällig am 01.04.2035		200		201	0,05
NON-AGENCY-MBS					
Ashford Hospitality Trust					
6,219 % fällig am 15.04.2035		1.051		1.027	0,25
6,319 % fällig am 15.06.2035		1.128		1.099	0,27
Banc of America Funding Trust					
5,537 % fällig am 20.10.2036		46		37	0,01
Barclays Commercial Mortgage Securities Trust					
6,193 % fällig am 15.07.2037		1.361		1.332	0,32
Chase Mortgage Finance Trust					
4,529 % fällig am 25.07.2037		39		30	0,01
Citigroup Commercial Mortgage Trust					
3,251 % fällig am 10.05.2035		964		896	0,22
Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.					
3,928 % fällig am 25.05.2035	$	22	$	21	0,01
Countrywide Alternative Loan Trust					
5,577 % fällig am 20.03.2046		20		17	0,00
5,577 % fällig am 20.05.2046 ^		24		21	0,01
6,000 % fällig am 25.03.2036 ^		380		176	0,04
6,000 % fällig am 25.05.2037 ^		197		96	0,02
Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust					
5,770 % fällig am 25.03.2035		263		225	0,05
DBWF Mortgage Trust					
6,276 % fällig am 19.12.2030		1.200		1.184	0,29
GSR Mortgage Loan Trust					
5,750 % fällig am 25.02.2036		147		127	0,03
HarborView Mortgage Loan Trust					
4,063 % fällig am 19.06.2036 ^		170		77	0,02
Lehman XS Trust					
5,670 % fällig am 25.02.2046 ^		191		169	0,04
Morgan Stanley Capital Trust					
6,093 % fällig am 15.07.2035		1.300		1.285	0,31
Residential Accredit Loans, Inc. Trust					
6,000 % fällig am 25.06.2036		271		216	0,05
6,000 % fällig am 25.09.2036 ^		280		131	0,03
Residential Asset Securitization Trust					
5,750 % fällig am 25.02.2036		958		739	0,18
Sequoia Mortgage Trust					
3,271 % fällig am 20.01.2047 ^		16		10	0,00
Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust					
4,082 % fällig am 25.10.2036 ^		62		36	0,01
5,470 % fällig am 25.10.2035		147		135	0,03
5,590 % fällig am 25.05.2037		26		22	0,01
Structured Asset Mortgage Investments Trust					
5,510 % fällig am 25.07.2046		436		363	0,09
5,550 % fällig am 25.05.2036		197		158	0,04
5,570 % fällig am 25.04.2036		15		13	0,00
5,986 % fällig am 19.10.2033		2		2	0,00
Structured Asset Securities Corp.					
5,430 % fällig am 25.01.2036		138		109	0,03
Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust					
5,440 % fällig am 25.10.2036		495		415	0,10
Tharaldson Hotel Portfolio Trust					
6,241 % fällig am 11.11.2034		1.296		1.280	0,31
WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust					
3,633 % fällig am 25.12.2036 ^		59		51	0,01
5,376 % fällig am 25.06.2042		1		1	0,00
5,710 % fällig am 25.11.2045		127		116	0,03
Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates Trust					
6,000 % fällig am 25.06.2037 ^		396		358	0,09
				11.974	2,91
US-REGIERUNGSBEHÖRDEN					
Fannie Mae					
3,000 % fällig am 01.03.2060		424		375	0,09
3,500 % fällig am 01.01.2059		1.280		1.168	0,28
5,550 % fällig am 25.06.2036		16		16	0,00
Freddie Mac					
0,000 % fällig am 15.01.2038 (a)		251		11	0,00
4,348 % fällig am 15.01.2038		251		244	0,06
Ginnie Mae					
3,000 % fällig am 20.07.2046 - 20.05.2047		9		8	0,00
5,434 % fällig am 20.12.2062		344		341	0,08
Uniform Mortgage-Backed Security					
2,500 % fällig am 01.02.2051 - 01.01.2052		1.959		1.667	0,41
3,000 % fällig am 01.10.2042 - 01.10.2049		1.541		1.375	0,33
3,500 % fällig am 01.10.2034 - 01.07.2050		876		815	0,20
4,000 % fällig am 01.09.2040 - 01.06.2050		518		495	0,12
4,500 % fällig am 01.04.2041		60		60	0,02
5,500 % fällig am 01.07.2037 - 01.04.2039		155		159	0,04
Uniform Mortgage-Backed Security, TBA					
2,500 % fällig am 01.08.2053		6.100		5.181	1,26
3,500 % fällig am 01.08.2053		1.800		1.642	0,40

BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
4,000 % fällig am 01.08.2053	$ 17.800	$ 16.720	4,06
4,500 % fällig am 01.08.2053	23.300	22.414	5,45
5,000 % fällig am 01.08.2053	17.400	17.054	4,14
5,500 % fällig am 01.08.2053	23.300	23.185	5,63
6,000 % fällig am 01.08.2053	32.100	32.378	7,87
6,500 % fällig am 01.07.2053	31.900	32.571	7,91
		157.879	38,35
US-SCHATZOBLIGATIONEN			
U.S. Treasury Bonds			
1,625 % fällig am 15.11.2050	1.300	808	0,20
1,875 % fällig am 15.02.2041	9.000	6.543	1,59
2,875 % fällig am 15.05.2052	300	249	0,06
4,000 % fällig am 15.11.2052	400	411	0,10
U.S. Treasury Inflation Protected Securities (e)			
0,125 % fällig am 15.04.2025	3.112	2.961	0,72
0,125 % fällig am 15.07.2030	2.011	1.804	0,44
0,125 % fällig am 15.07.2031	1.245	1.104	0,27
0,125 % fällig am 15.01.2032	3.939	3.470	0,84
0,250 % fällig am 15.01.2025	3.330	3.192	0,78
0,250 % fällig am 15.02.2050	1.180	826	0,20
0,500 % fällig am 15.01.2028	10.083	9.435	2,28
0,625 % fällig am 15.07.2032	1.670	1.536	0,37
0,750 % fällig am 15.07.2028	2.054	1.947	0,47
1,125 % fällig am 15.01.2033	3.869	3.710	0,90

BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
U.S. Treasury Notes			
2,875 % fällig am 30.04.2025	$ 9.300	$ 8.957	2,18
3,500 % fällig am 15.02.2033	1.300	1.266	0,31
4,000 % fällig am 29.02.2028	300	298	0,07
		48.517	11,78
Summe USA		256.683	62,35
KURZFRISTIGE INSTRUMENTE			
COMMERCIAL PAPER			
Conagra Foods, Inc.			
5,750 % fällig am 05.07.2023	500	499	0,12
Global Payments, Inc.			
5,930 % fällig am 28.07.2023	300	299	0,08
		798	0,20
ARGENTINA TREASURY BILLS			
(28,578) % fällig am 18.10.2023 (c)(d)	ARS 13.855	28	0,01
(12,549) % fällig am 23.11.2023 (c)(d)	13.517	28	0,01
		56	0,02

BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
HUNGARY TREASURY BILLS			
16,220 % fällig am 06.07.2023 (c)(d)	HUF 831.000	$ 2.426	0,58
Summe kurzfristige Instrumente		3.280	0,80
Summe Übertragbare Wertpapiere		**$ 518.780**	**126,03**
	AKTIEN		
INVESTMENTFONDS			
ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN			
PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (g)	1.573.660	15.670	3,81
PIMCO Specialty Funds Ireland p.l.c. - PIMCO China Bond Fund (g)	446.527	5.819	1,41
Summe Investmentfonds		**$ 21.489**	**5,22**

PENSIONSGESCHÄFTE

Kontrahent	Kredit-zins	Abrechnungs-datum	Fälligkeits-datum	Kapital-betrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensions-geschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensions-geschäft[1]	% des Nettovermögens
FICC	2,400 %	30.06.2023	03.07.2023	$ 2.347	U.S. Treasury Notes 4,625 % fällig am 30.06.2025	$ (2.394)	$ 2.347	$ 2.347	0,57
Summe Pensionsgeschäfte						**$ (2.394)**	**$ 2.347**	**$ 2.347**	**0,57**

[1] Umfasst aufgelaufene Zinsen.

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

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

FUTURES

Beschreibung	Art	Ablauf-monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
3-Month SOFR December Futures	Short	03.2024	96	$ 255	0,06
3-Month SOFR June Futures	Short	09.2024	41	14	0,00
3-Month SOFR March Futures	Long	06.2024	41	(9)	0,00
Australia Government 3-Year Note September Futures	Short	09.2023	28	11	0,00
Australia Government 10-Year Bond September Futures	Short	09.2023	50	20	0,00
Kaufoptionen mit Ausübungskurs bei 170,000 EUR auf Euro-OAT September 2023 Futures[1]	Long	08.2023	41	0	0,00
Canada Government 10-Year Bond September Futures	Short	09.2023	1	2	0,00
Euro-Bobl September Futures	Short	09.2023	202	368	0,09
Euro-BTP Italy Government Bond September Futures	Short	09.2023	118	(129)	(0,03)
Euro-BTP Italy Government Bond September Futures	Short	09.2023	105	113	0,03
Euro-Bund 10-Year Bond September Futures	Short	09.2023	4	5	0,00
Euro-Buxl 30-Year Bond September Futures	Short	09.2023	5	(11)	0,00
Euro-OAT France Government 10-Year Bond September Futures	Short	09.2023	213	235	0,06
Euro-Schatz September Futures	Short	09.2023	272	64	0,02
Japan Government 10-Year Bond September Futures	Short	09.2023	11	(41)	(0,01)
U.S. Treasury 2-Year Note September Futures	Short	09.2023	10	30	0,01
U.S. Treasury 5-Year Note September Futures	Short	09.2023	107	212	0,05
U.S. Treasury 10-Year Note September Futures	Long	09.2023	5	(6)	0,00
U.S. Treasury 10-Year Ultra September Futures	Short	09.2023	67	90	0,02
U.S. Treasury 30-Year Bond September Futures	Short	09.2023	24	1	0,00
U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond September Futures	Long	09.2023	3	6	0,00
United Kingdom Long Gilt September Futures	Short	09.2023	135	175	0,04
				$ 1.405	0,34

[1] Future-Style-Option.

VERKAUFSOPTIONEN

OPTIONEN AUF BÖRSENGEHANDELTE TERMINKONTRAKTE

Beschreibung	Ausübungskurs	Verfallsdatum	Anzahl der Kontrakte	Aufgeld	Marktwert	% des Nettovermögens
Put - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note August Futures	$ 111,500	21.07.2023	9	$ (4)	$ (3)	0,00
Call - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note August Futures	115,500	21.07.2023	9	(3)	(1)	0,00
Call - CME-Kaufoptionen mit Ausübungskurs bei 98,000 USD auf 3-Month SOFR December Futures	98,000	15.12.2023	7	(6)	0	0,00
Put - CME-Verkaufsoptionen mit Ausübungskurs bei 96,500 USD auf 3-Month SOFR December Futures	96,500	15.12.2023	7	(6)	(33)	(0,01)
				$ (19)	$ (37)	(0,01)
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate					**$ 1.368**	**0,33**

ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)

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

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMMISSIONEN - SCHUTZVERKAUF[1]

Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag[3]	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
AT&T, Inc.	1,000 %	20.12.2023	$ 300	$ (3)	0,00
Ford Motor Credit Co. LLC	5,000	20.06.2025	400	12	0,00
				$ 9	0,00

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES - SCHUTZKAUF[2]

Index/Tranchen	Zu bezahlender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag[3]	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
CDX.IG-40 10-Year Index	(1,000) %	20.06.2033	$ 59.000	$ (606)	(0,15)
iTraxx Europe Main 39 10-Year Index	(1,000)	20.06.2033	€ 6.700	(94)	(0,02)
				$ (700)	(0,17)

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF[1]

Index/Tranchen	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag[3]	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
CDX.IG-40 5-Year Index	1,000 %	20.06.2028	$ 39.700	$ 189	0,05

ZINSSWAPS

Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	% des Nettovermögens
Zahlung[4]	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	3,250 %	20.09.2053	£ 900	$ (80)	(0,02)
Zahlung[4]	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	3,500	20.09.2033	31.900	(1.727)	(0,42)
Zahlung[4]	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	3,750	20.09.2028	3.200	(204)	(0,05)
Zahlung[4]	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	4,000	20.09.2025	900	(33)	(0,01)
Erhalt	1-Day INR-MIBOR Compounded-OIS	6,250	16.03.2032	INR 63.900	(56)	(0,01)
Zahlung	1-Day INR-MIBOR Compounded-OIS	6,500	15.03.2028	678.215	(27)	(0,01)
Zahlung	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,000	15.12.2028	¥ 250.000	(19)	0,00
Zahlung	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,000	17.03.2031	230.000	(36)	(0,01)
Zahlung	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,050	15.12.2031	440.000	(21)	(0,01)
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,400	19.06.2039	280.000	174	0,04
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,789	23.01.2033	1.356.000	(230)	(0,06)
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,800	15.06.2052	300.000	118	0,03
Zahlung	1-Day SGD-SIBCSORA Compounded-OIS	3,000	15.03.2028	SGD 2.370	(45)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	0,000	25.08.2023	$ 8.100	(112)	(0,03)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	0,000	31.08.2023	9.500	(132)	(0,03)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	0,000	15.09.2023	10.200	(142)	(0,03)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	0,000	18.09.2023	200	(3)	0,00
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,000	15.06.2027	10.400	878	0,21
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,000	15.06.2029	10.080	(501)	(0,12)
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,249	31.08.2024	9.500	664	0,16
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,250	15.12.2026	10.200	1.192	0,30
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,298	25.08.2024	8.100	579	0,14
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,430	31.03.2024	200	6	0,00
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,500	18.12.2024	200	18	0,00
Zahlung[4]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,500	15.12.2028	9.900	(1.309)	(0,32)
Zahlung[4]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,518	20.01.2029	800	(99)	(0,02)
Zahlung[4]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,630	20.01.2029	2.300	(272)	(0,07)
Zahlung[4]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,630	26.01.2029	500	(59)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,750	15.06.2024	10.740	81	0,02
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,750	15.06.2027	19.230	344	0,08
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,750	15.06.2052	520	15	0,00

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits-datum		Nenn-betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,850 %	21.04.2024	$	21.900	$ 498	0,12
Zahlung[4]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,000	15.12.2051		2.000	(699)	(0,17)
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,209	31.03.2024		2.236	68	0,02
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,400	21.06.2024		600	(16)	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,750	21.06.2053		1.080	(34)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,906	16.09.2052		600	(40)	(0,01)
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,965	30.11.2026		16.400	825	0,20
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,968	30.06.2024		13.100	(301)	(0,07)
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,000	21.06.2033		3.980	63	0,01
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,050	08.09.2029		400	(17)	0,00
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,070	15.11.2032		2.500	112	0,03
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,083	15.11.2032		2.300	100	0,02
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,086	15.11.2032		2.600	87	0,02
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,100	09.09.2029		1.200	(48)	(0,01)
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,106	15.11.2032		1.900	79	0,02
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,139	15.11.2032		2.400	94	0,02
Erhalt[4]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,150	13.05.2025		42.700	416	0,10
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,163	30.09.2029		3.100	(117)	(0,03)
Zahlung[4]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,165	03.10.2053		600	2	0,00
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,173	15.11.2032		1.700	63	0,01
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,174	15.11.2032		1.800	65	0,02
Erhalt[4]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,200	13.05.2025		2.700	31	0,01
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,225	30.09.2029		2.100	(73)	(0,02)
Zahlung[4]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,240	03.10.2053		600	10	0,00
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,250	21.06.2028		7.400	81	0,02
Zahlung[4]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,250	20.12.2053		2.400	10	0,00
Erhalt[4]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,445	03.10.2038		1.800	1	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,454	30.06.2029		2.900	(51)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,470	22.02.2030		700	(12)	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,500	22.06.2030		1.000	(9)	0,00
Erhalt[4]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,500	20.12.2030		100	1	0,00
Erhalt[4]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,500	20.12.2033		301	(2)	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,525	02.03.2030		400	(6)	0,00
Erhalt[4]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,533	03.10.2038		1.800	(18)	0,00
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,750	21.06.2025		9.600	154	0,04
Erhalt[4]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,750	20.12.2028		5.584	49	0,01
Zahlung[4]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,752	03.10.2028		2.300	(4)	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,800	10.03.2028		700	(6)	0,00
Zahlung[4]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,850	03.10.2028		2.300	6	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,898	30.06.2029		3.200	18	0,00
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	4,159	31.03.2025		14.500	232	0,06
Erhalt[4]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	4,250	20.12.2025		31.996	169	0,04
Zahlung[4]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	4,409	04.10.2024		4.500	(57)	(0,01)
Erhalt[4]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	4,409	04.10.2024		4.500	59	0,01
Zahlung[4]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	4,427	27.09.2024		10.300	(122)	(0,03)
Erhalt[4]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	4,427	27.09.2024		10.300	105	0,03
Zahlung[4]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	4,433	06.09.2024		21.300	(257)	(0,07)
Erhalt[4]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	4,433	06.09.2024		21.300	222	0,06
Zahlung[4]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	4,789	07.03.2024		3.400	(27)	(0,01)
Erhalt[4]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	4,789	07.03.2024		3.400	15	0,00
Erhalt	1-Year BRL-CDI	6,280	04.01.2027	BRL	1.600	27	0,01
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	1,220	03.03.2025	CAD	6.700	(402)	(0,10)
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	1,500	17.06.2025		2.600	(159)	(0,04)
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	1,500	17.06.2030		1.600	(131)	(0,03)
Erhalt	3-Month CAD-Bank Bill	1,750	16.12.2046		1.400	162	0,04
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	1,900	18.12.2029		3.700	(336)	(0,08)
Erhalt	3-Month CAD-Bank Bill	3,250	15.03.2033		1.900	69	0,02
Zahlung	3-Month CAD-CAONREPO Compounded-OIS	3,250	21.06.2033		7.000	49	0,01
Erhalt	3-Month CAD-CAONREPO Compounded-OIS	3,250	21.06.2053		3.000	(61)	(0,01)
Zahlung[4]	3-Month CAD-CAONREPO Compounded-OIS	3,500	10.05.2025		58.900	(361)	(0,09)
Zahlung	3-Month CHF-SRFXON3 Compounded-OIS	0,283	14.02.2027	CHF	1.700	(115)	(0,03)
Zahlung	3-Month CHF-SRFXON3 Compounded-OIS	0,294	10.02.2027		4.400	(285)	(0,07)
Zahlung	3-Month CHF-SRFXON3 Compounded-OIS	0,300	15.02.2027		1.700	(113)	(0,03)
Zahlung	3-Month CHF-SRFXON3 Compounded-OIS	0,343	16.05.2027		1.300	(86)	(0,02)
Zahlung	3-Month CHF-SRFXON3 Compounded-OIS	0,500	15.09.2026		900	(79)	(0,02)
Erhalt	3-Month CNY-CNREPOFIX	2,250	21.12.2027	CNY	12.600	(31)	(0,01)
Erhalt	3-Month CNY-CNREPOFIX	2,500	21.12.2027		69.500	(165)	(0,04)
Erhalt	3-Month CNY-CNREPOFIX	2,750	21.06.2028		25.500	(60)	(0,01)
Zahlung	3-Month EUR-ESTRON Compounded-OIS	1,000	23.11.2024	€	9.400	(174)	(0,04)
Zahlung	3-Month KRW-KORIBOR	3,250	15.03.2028	KRW	22.984.540	(309)	(0,08)
Erhalt	3-Month KRW-KORIBOR	3,250	15.03.2033		472.359	1	0,00
Erhalt[4]	3-Month KRW-KORIBOR	3,250	20.09.2033		2.534.930	5	0,00
Zahlung	3-Month NZD-BBR	0,528	17.03.2024	NZD	350	(7)	0,00
Zahlung	3-Month NZD-BBR	3,250	21.03.2028		2.600	(294)	(0,07)
Zahlung	3-Month NZD-BBR	3,750	15.06.2027		4.100	(38)	(0,01)
Zahlung	3-Month NZD-BBR	4,000	14.06.2024		24.900	(225)	(0,05)
Zahlung[4]	3-Month NZD-BBR	4,750	20.03.2025		12.400	(43)	(0,01)
Zahlung[4]	3-Month NZD-BBR	5,250	20.03.2025		11.700	(8)	0,00
Zahlung	3-Month SEK-STIBOR	0,500	19.06.2024	SEK	12.700	(58)	(0,01)
Zahlung	3-Month SEK-STIBOR	1,000	19.06.2029		16.100	(223)	(0,05)
Erhalt	3-Month THB-THORON Compounded-OIS	2,250	15.03.2028	THB	138.460	47	0,01

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits-datum		Nenn-betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	0,000 %	25.08.2023	$	8.100	$ 112	0,03
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	0,000	31.08.2023		9.500	133	0,03
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	0,000	15.09.2023		10.200	145	0,03
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	0,000	18.09.2023		200	3	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,500	15.09.2023		9.900	(103)	(0,03)
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,518	20.07.2023		800	(5)	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,630	20.07.2023		2.300	(12)	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,630	26.07.2023		500	(3)	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	2,000	15.09.2023		2.000	(18)	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	4,409	04.07.2023		4.500	10	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	4,409	04.07.2023		4.500	(10)	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	4,427	27.07.2023		10.300	(7)	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	4,427	27.09.2023		10.300	32	0,01
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	4,433	06.07.2023		21.300	(9)	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	4,433	06.09.2023		21.300	63	0,02
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	4,789	07.07.2023		3.400	(2)	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	4,789	07.09.2023		3.400	7	0,00
Erhalt	6-Month AUD-BBR-BBSW	1,250	17.06.2030	AUD	5.700	563	0,14
Zahlung	6-Month AUD-BBR-BBSW	1,750	16.03.2027		1.900	(114)	(0,03)
Erhalt	6-Month AUD-BBR-BBSW	1,750	16.06.2031		1.750	205	0,05
Zahlung	6-Month AUD-BBR-BBSW	4,000	21.06.2033		4.200	(115)	(0,03)
Zahlung[4]	6-Month AUD-BBR-BBSW	4,250	15.09.2032		1.100	(5)	0,00
Zahlung	6-Month AUD-BBR-BBSW	4,250	15.03.2033		12.400	(247)	(0,06)
Zahlung[4]	6-Month AUD-BBR-BBSW	4,500	15.09.2032		22.500	39	0,01
Erhalt[4]	6-Month EUR-EURIBOR	0,054	27.05.2050	€	200	51	0,01
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	0,064	17.11.2052		500	178	0,04
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	0,450	15.12.2035		300	86	0,02
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	0,550	10.08.2024		500	(22)	(0,01)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	0,650	12.04.2027		1.400	(149)	(0,04)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	0,650	11.05.2027		900	(94)	(0,02)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	0,700	11.04.2027		700	(73)	(0,02)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	1,000	13.05.2027		1.600	(150)	(0,04)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	1,000	18.05.2027		700	(66)	(0,02)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,100	11.04.2024		3.900	(61)	(0,02)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,100	13.04.2024		8.800	(138)	(0,03)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,100	17.05.2024		1.800	(30)	(0,01)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,250	26.04.2024		1.300	(18)	0,00
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,250	28.04.2024		1.300	(19)	0,00
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,250	03.05.2024		1.200	(18)	0,00
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,250	21.09.2037		1.400	(28)	(0,01)
Erhalt[4]	6-Month EUR-EURIBOR	2,500	20.09.2053		12.800	(107)	(0,03)
Zahlung[4]	6-Month EUR-EURIBOR	3,000	19.03.2027		17.660	(119)	(0,03)
Zahlung[4]	6-Month EUR-EURIBOR	3,000	20.09.2028		36.200	(214)	(0,05)
Erhalt[4]	6-Month EUR-EURIBOR	3,000	15.03.2033		7.860	(21)	(0,01)
Zahlung[4]	6-Month EUR-EURIBOR	3,000	20.09.2033		69.300	285	0,07
Erhalt[4]	6-Month EUR-EURIBOR	3,500	20.09.2025		15.700	(5)	0,00
Erhalt	6-Month NOK-NIBOR	1,635	18.03.2025	NOK	6.200	43	0,01
Erhalt	6-Month NOK-NIBOR	1,993	12.11.2024		4.200	26	0,01
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	4,870	07.07.2025	MXN	41.500	(119)	(0,03)
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	6,080	26.02.2025		10.500	(38)	(0,01)
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	6,380	25.02.2025		12.300	(48)	(0,01)
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	6,415	25.02.2025		300	(1)	0,00
						$ (2.929)	(0,71)
Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate						**$ (3.431)**	**(0,83)**

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

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

(3) Der maximal mögliche Betrag, den der Fonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

(4) Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft.

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

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

OPTIONSKAUF

ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag[1]	Kosten	Markt-wert	% des Nettovermögens
BOA	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,180 %	11.01.2024	1.900	$ 54	$ 195	0,05

OPTIONEN AUF WERTPAPIERE

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag[1]	Kosten	Markt-wert	% des Nettovermögens
BPS	Put - OTC France Government International Bond 0,750 % fällig am 25.05.2052	€ 97,000	23.05.2025	800	$ 61	$ 334	0,08

VERKAUFSOPTIONEN

ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag[1]	Aufgeld	Markt-wert	% des Nettovermögens
BOA	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,150 %	01.12.2023	1.300	$ (4)	$ 0	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,650	01.12.2023	1.300	(4)	(18)	(0,01)
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,310	11.01.2024	16.900	(55)	(409)	(0,10)
	Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,070	10.07.2023	300	(2)	(1)	0,00
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,370	10.07.2023	300	(2)	0	0,00
	Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,060	14.07.2023	200	(1)	(1)	0,00
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,360	14.07.2023	200	(1)	(1)	0,00
BPS	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,200	06.07.2023	210	(1)	0	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,650	06.07.2023	210	(1)	0	0,00
	Put - OTC 25-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	0,451	23.05.2025	800	(60)	(306)	(0,08)
	Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,000	03.07.2023	100	(1)	0	0,00
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,400	03.07.2023	100	(1)	0	0,00
DUB	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,920	13.10.2023	700	(4)	0	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,920	13.10.2023	700	(4)	(15)	(0,01)
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,790	08.04.2024	1.700	(13)	(2)	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,790	08.04.2024	1.700	(13)	(30)	(0,01)
FAR	Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,100	31.08.2023	900	(7)	(1)	0,00
	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,800	31.08.2023	900	(7)	(9)	0,00
GLM	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,920	13.10.2023	500	(3)	0	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,920	13.10.2023	500	(3)	(11)	0,00
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,018	20.10.2023	500	(3)	0	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,018	20.10.2023	500	(3)	(10)	0,00
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,140	23.10.2023	600	(4)	0	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,140	23.10.2023	600	(4)	(12)	0,00
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,190	23.10.2023	600	(4)	0	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,190	23.10.2023	600	(4)	(11)	0,00
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,225	23.10.2023	500	(3)	0	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,225	23.10.2023	500	(3)	(9)	0,00
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,973	25.10.2023	600	(4)	0	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,973	25.10.2023	600	(4)	(12)	0,00
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,841	27.10.2023	400	(3)	0	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,841	27.10.2023	400	(3)	(9)	0,00
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,088	03.11.2023	300	(2)	0	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,088	03.11.2023	300	(2)	(6)	0,00
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,910	10.11.2023	900	(6)	0	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,910	10.11.2023	900	(6)	(19)	(0,01)
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,250	17.11.2023	1.600	(6)	0	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,750	17.11.2023	1.600	(6)	(21)	(0,01)
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,150	20.11.2023	1.000	(3)	0	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,650	20.11.2023	1.000	(3)	(14)	0,00
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,250	07.12.2023	900	(3)	0	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,750	07.12.2023	900	(3)	(11)	0,00
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,697	02.04.2024	2.000	(16)	(2)	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,697	02.04.2024	2.000	(16)	(37)	(0,01)
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,721	08.04.2024	600	(5)	(1)	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,721	08.04.2024	600	(5)	(11)	0,00
JPM	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	6-Month GBP-LIBOR	Erhalt	0,820	16.12.2024	4.600	(32)	(5)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,300	10.07.2023	200	(1)	0	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,750	10.07.2023	200	(1)	0	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,250	20.07.2023	700	(2)	(1)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,650	20.07.2023	700	(2)	(3)	0,00
MYC	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,993	11.10.2023	400	(3)	0	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,993	11.10.2023	400	(3)	(8)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,200	06.07.2023	190	(1)	0	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,650	06.07.2023	190	(1)	0	0,00
							$ (357)	$ (1.006)	(0,24)

(1) Der Nennbetrag stellt die Anzahl der Kontrakte dar.

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMMISSIONEN - SCHUTZVERKAUF[1]

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag[2]	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Markt-wert	% des Nettovermögens
BOA	Italy Government International Bond	1,000 %	20.06.2025	$ 500	$ (12)	$ 18	$ 6	0,00
BRC	Italy Government International Bond	1,000	20.06.2025	400	(10)	15	5	0,00
CBK	Italy Government International Bond	1,000	20.06.2025	500	(12)	18	6	0,00
					$ (34)	$ 51	$ 17	0,00

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

(2) Der maximal mögliche Betrag, den der Fonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

CROSS-CURRENCY SWAPS

Kontrahent	Erhalt	Zahlung	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag erhaltener Währung	Nennbetrag gelieferter Währung	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Marktwert	% des Nettovermögens
AZD	Variabler Zinssatz entspricht 3-Month AUD-LIBOR zzgl. 0,290 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung	Variabler Zinssatz entspricht 3-Month USD-LIBOR basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung	04.01.2031	AUD 700	$ 527	$ 3	$ (2)	$ 1	0,00
CBK	Variabler Zinssatz entspricht 3-Month AUD-LIBOR zzgl. 0,420 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung	Variabler Zinssatz entspricht 3-Month USD-LIBOR basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung	31.07.2029	5.900	4.071	(1)	10	9	0,00
GLM	Variabler Zinssatz entspricht 3-Month AUD-LIBOR zzgl. 0,423 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung	Variabler Zinssatz entspricht 3-Month USD-LIBOR basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung	01.08.2029	5.600	3.864	(11)	9	(2)	0,00
						$ (9)	$ 17	$ 8	0,00

ZINSSWAPS

Kontrahent	Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Marktwert	% des Nettovermögens
BOA	Erhalt	3-Month MYR-KLIBOR	3,500 %	15.03.2028	MYR 20.216	$ (8)	$ 37	$ 29	0,01
	Erhalt	3-Month MYR-KLIBOR	3,750	15.03.2033	12.340	(3)	31	28	0,01
BPS	Erhalt	3-Month MYR-KLIBOR	3,500	15.03.2028	5.219	(2)	10	8	0,00
GLM	Erhalt	3-Month MYR-KLIBOR	3,545	05.05.2028	3.753	0	4	4	0,00
	Erhalt	3-Month MYR-KLIBOR	3,635	05.04.2024	7.015	(2)	1	(1)	0,00
	Erhalt	3-Month MYR-KLIBOR	3,750	15.03.2033	1.606	3	1	4	0,00
JPM	Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	5,960	11.02.2029	COP 15.800	0	0	0	0,00
SCX	Erhalt	3-Month MYR-KLIBOR	3,750	15.03.2028	MYR 3.400	(10)	8	(2)	0,00
						$ (22)	$ 92	$ 70	0,02

DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungsmonat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2023	MXN 26.761	$ 1.454	$ 0	$ (103)	$ (103)	(0,02)
	07.2023	NZD 208	126	0	(1)	(1)	0,00
	07.2023	PLN 515	124	0	(3)	(3)	0,00
	07.2023	$ 1.705	£ 1.348	9	0	9	0,00
	08.2023	AUD 270	$ 178	0	(2)	(2)	0,00
	08.2023	CNH 3.527	505	18	0	18	0,00
	08.2023	$ 5.586	AUD 8.264	0	(79)	(79)	(0,02)
	08.2023	603	CAD 796	0	(1)	(1)	0,00
	08.2023	165	CNH 1.157	0	(6)	(6)	0,00
	08.2023	5.104	CNY 35.027	0	(258)	(258)	(0,06)
	08.2023	454	¥ 64.900	0	(2)	(2)	0,00
	09.2023	TWD 16.946	$ 558	13	0	13	0,00
	09.2023	$ 446	CLP 364.511	4	0	4	0,00
	09.2023	1.461	HKD 11.414	0	(2)	(2)	0,00
	09.2023	926	INR 76.598	5	0	5	0,00
	09.2023	476	KRW 603.042	0	(16)	(16)	0,00
	09.2023	440	PEN 1.614	3	0	3	0,00
BPS	07.2023	463	CZK 9.957	0	(6)	(6)	0,00
	07.2023	504	£ 393	0	(4)	(4)	0,00
	07.2023	481	MYR 2.210	0	(7)	(7)	0,00
	07.2023	53	SGD 71	0	(1)	(1)	0,00
	08.2023	CNH 26.112	$ 3.703	101	0	101	0,02
	08.2023	€ 1.979	2.170	7	0	7	0,00
	08.2023	TWD 8.482	278	5	0	5	0,00
	08.2023	$ 5.356	CNH 36.999	0	(253)	(253)	(0,06)
	08.2023	6.024	CNY 41.189	0	(326)	(326)	(0,08)
	08.2023	3.555	€ 3.250	1	(3)	(2)	0,00
	08.2023	313	ZAR 5.812	0	(6)	(6)	0,00
	09.2023	THB 8	$ 0	0	0	0	0,00
	09.2023	$ 570	IDR 8.572.440	0	(1)	(1)	0,00
	12.2023	330	MXN 5.886	3	0	3	0,00
BRC	07.2023	422	£ 333	2	0	2	0,00
	07.2023	63	MYR 289	0	(1)	(1)	0,00
	08.2023	257	CNH 1.825	0	(6)	(6)	0,00
	08.2023	848	COP 3.613.553	7	0	7	0,00
	08.2023	858	¥ 113.582	0	(67)	(67)	(0,02)

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung		Zu erhaltende Währung		Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
	08.2023	$	339	ZAR	6.266	$ 0	$ (9)	$ (9)	0,00
	09.2023	IDR	39.603	$	3	0	0	0	0,00
	09.2023	ILS	24		7	0	0	0	0,00
	09.2023	$	25	IDR	373.724	0	0	0	0,00
	09.2023		64	PEN	233	0	0	0	0,00
BSH	07.2023		554		2.040	8	0	8	0,00
CBK	07.2023	BRL	1.268	$	258	0	(5)	(5)	0,00
	07.2023	CLP	208.540		258	0	(2)	(2)	0,00
	07.2023	IDR	372.985		25	0	0	0	0,00
	07.2023	NZD	650		399	0	0	0	0,00
	07.2023	PEN	33.120		8.524	0	(613)	(613)	(0,15)
	07.2023	$	408	CZK	8.787	0	(5)	(5)	0,00
	07.2023		10.083	PEN	36.727	48	0	48	0,01
	07.2023		959	PHP	52.328	0	(13)	(13)	0,00
	07.2023		873	RON	3.946	0	(5)	(5)	0,00
	08.2023	CLP	304.881	$	368	0	(11)	(11)	0,00
	08.2023	CNH	5.595		803	31	0	31	0,01
	08.2023	DKK	61.305		8.855	0	(150)	(150)	(0,04)
	08.2023	€	972		1.046	0	(17)	(17)	0,00
	08.2023	TWD	8.831		289	6	0	6	0,00
	08.2023	$	363	BRL	1.875	24	0	24	0,01
	08.2023		3.425	CAD	4.594	49	0	49	0,01
	08.2023		14	CNH	97	0	(1)	(1)	0,00
	08.2023		2.098	€	1.908	4	(16)	(12)	0,00
	08.2023		2.096	NOK	21.868	0	(52)	(52)	(0,01)
	08.2023		723	PEN	2.824	53	0	53	0,01
	08.2023		2.916	SEK	29.569	0	(173)	(173)	(0,04)
	09.2023	CNH	9.742	$	1.367	20	0	20	0,00
	09.2023	KRW	5.414		4	0	0	0	0,00
	09.2023	$	1.419	THB	49.085	1	(25)	(24)	(0,01)
	09.2023		1.090	VND	25.691.912	1	0	1	0,00
	10.2023	CLP	1.390	$	2	0	0	0	0,00
	11.2023	ILS	5.907		1.765	163	0	163	0,04
CLY	08.2023	$	245	CNH	1.739	0	(5)	(5)	0,00
	08.2023		2.367	NOK	24.805	0	(48)	(48)	(0,01)
DUB	07.2023	PEN	59.407	$	16.296	0	(89)	(89)	(0,02)
	07.2023	$	5.323	BRL	28.844	655	0	655	0,16
	07.2023		8.121	PEN	29.704	73	0	73	0,02
	08.2023	TWD	11.514	$	377	7	0	7	0,00
	09.2023	$	289	PEN	1.057	2	0	2	0,00
GLM	07.2023	BRL	29.117	$	6.030	0	(6)	(6)	0,00
	07.2023	IDR	373.975		25	0	0	0	0,00
	07.2023	PEN	3.705		1.015	0	(7)	(7)	0,00
	07.2023	$	287	BRL	1.449	13	0	13	0,00
	08.2023		1.696	CHF	1.501	0	(11)	(11)	0,00
	08.2023		922	NOK	9.780	0	(7)	(7)	0,00
	08.2023		457	PEN	1.667	1	0	1	0,00
	09.2023		6.030	BRL	29.440	5	0	5	0,00
	09.2023		558	PEN	2.052	5	0	5	0,00
	09.2023		1.997	SGD	2.670	0	(18)	(18)	0,00
	09.2023		1	THB	34	0	0	0	0,00
JPM	07.2023	KRW	5.164.251	$	4.042	120	0	120	0,03
	07.2023	SGD	277		210	5	0	5	0,00
	07.2023	$	63	PHP	3.424	0	(1)	(1)	0,00
	07.2023		1.678	SGD	2.218	0	(39)	(39)	(0,01)
	08.2023	CNH	2.069	$	290	5	0	5	0,00
	08.2023	HUF	130.000		377	2	0	2	0,00
	08.2023	$	3.052	CAD	4.080	33	0	33	0,01
	08.2023		2.556	CHF	2.248	0	(33)	(33)	(0,01)
	08.2023		4.096	CNH	28.306	0	(192)	(192)	(0,05)
	08.2023		6.354	CNY	43.453	0	(342)	(342)	(0,08)
	08.2023		141	¥	18.666	0	(11)	(11)	0,00
	08.2023		340	NOK	3.606	0	(3)	(3)	0,00
	09.2023	IDR	40.699	$	3	0	0	0	0,00
	09.2023	ILS	23		6	0	0	0	0,00
	09.2023	$	1	IDR	9.960	0	0	0	0,00
	09.2023		6.812	INR	561.424	12	0	12	0,00
	09.2023		4.395	PEN	16.181	43	0	43	0,01
	09.2023		1.357	THB	46.527	0	(35)	(35)	(0,01)
	12.2023		2.118	INR	174.780	0	(1)	(1)	0,00
	10.2024	¥	110.000	$	890	74	0	74	0,02
MBC	07.2023	£	10.482		13.024	9	(311)	(302)	(0,07)
	08.2023	CAD	498		375	1	(2)	(1)	0,00
	08.2023	CNH	7.796		1.100	25	0	25	0,01
	08.2023	€	20.657		22.784	204	(2)	202	0,05
	08.2023	$	248	CNH	1.783	0	(2)	(2)	0,00
	08.2023		549	HUF	187.162	0	(8)	(8)	0,00
	09.2023	IDR	943	$	0	0	0	0	0,00
	09.2023	$	176	IDR	2.614.097	0	(2)	(2)	0,00
	09.2023		803	KRW	1.023.838	0	(23)	(23)	(0,01)
	10.2024	¥	340.000	$	2.725	203	0	203	0,05

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung		Zu erhaltende Währung		Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
MYI	07.2023	£	290	$	360	$ 0	$ (8)	$ (8)	0,00
	07.2023	IDR	498.726		33	0	0	0	0,00
	07.2023	$	2	€	2	0	0	0	0,00
	07.2023		8	IDR	122.933	0	0	0	0,00
	07.2023		366	KZT	171.575	12	0	12	0,00
	07.2023		20	MYR	92	0	0	0	0,00
	08.2023	¥	41.300	$	298	10	0	10	0,00
	08.2023	TWD	16.924		557	13	0	13	0,00
	08.2023	$	670	€	613	1	0	1	0,00
	08.2023		12.239	¥	1.626.444	0	(914)	(914)	(0,22)
	08.2023		69	ZAR	1.340	2	0	2	0,00
	09.2023	IDR	123.040	$	8	0	0	0	0,00
	09.2023	$	816	IDR	12.183.983	0	(6)	(6)	0,00
	09.2023		1.470	INR	121.264	4	0	4	0,00
	09.2023		899	KRW	1.150.628	0	(22)	(22)	(0,01)
	09.2023		619	THB	21.208	0	(17)	(17)	0,00
	10.2024	¥	600.000	$	4.906	456	0	456	0,11
RBC	07.2023	$	5.604	MXN	107.822	671	0	671	0,16
	08.2023	CHF	59	$	67	0	0	0	0,00
	08.2023	MXN	5.115		295	0	(1)	(1)	0,00
SCX	07.2023	NZD	541		329	0	(3)	(3)	0,00
	07.2023	$	482	MYR	2.217	0	(6)	(6)	0,00
	08.2023	TWD	6.147		201	4	0	4	0,00
	08.2023	$	425	AUD	634	0	(2)	(2)	0,00
	08.2023		2.269	CNH	15.609	0	(117)	(117)	(0,03)
	08.2023		16.900	CNY	115.378	0	(937)	(937)	(0,23)
	08.2023		259	€	237	0	0	0	0,00
	08.2023		417	¥	57.800	0	(15)	(15)	0,00
	09.2023	CNH	2.191	$	307	4	0	4	0,00
	09.2023	TWD	14.174		465	9	0	9	0,00
	09.2023	$	2.241	IDR	33.519.603	0	(15)	(15)	0,00
	09.2023		4.263	INR	351.124	5	0	5	0,00
	09.2023		818	KRW	1.042.034	0	(24)	(24)	(0,01)
	09.2023		248	PEN	919	4	0	4	0,00
	09.2023		1.894	THB	65.396	0	(36)	(36)	(0,01)
SOG	07.2023		2.302	PLN	9.918	137	0	137	0,03
SSB	07.2023		260	CLP	208.839	0	0	0	0,00
	07.2023		8.144	PEN	29.705	47	0	47	0,01
	08.2023	CLP	209.442	$	260	0	0	0	0,00
	08.2023	PEN	29.705		8.133	0	(42)	(42)	(0,01)
	09.2023	BRL	1.918		378	0	(15)	(15)	0,00
	09.2023	KRW	2.672.560		2.061	24	0	24	0,01
TOR	07.2023	$	11.053	£	8.698	6	0	6	0,00
	07.2023		852	NZD	1.399	5	0	5	0,00
	08.2023	CAD	404	$	300	0	(6)	(6)	0,00
	08.2023	£	8.698		11.055	0	(5)	(5)	0,00
	08.2023	NZD	1.399		852	0	(5)	(5)	0,00
	08.2023	$	5.649	¥	749.077	0	(433)	(433)	(0,11)
UAG	08.2023	CAD	76	$	56	0	(1)	(1)	0,00
	08.2023	$	500	CNH	3.467	0	(22)	(22)	(0,01)
	08.2023		215	€	196	0	(1)	(1)	0,00
	08.2023		132	ZAR	2.531	2	0	2	0,00
	09.2023	CNH	2.939	THB	14.234	0	(2)	(2)	0,00
	09.2023	SGD	2.123	$	1.588	15	0	15	0,00
	09.2023	$	877	INR	72.464	4	0	4	0,00
	09.2023		447	ZAR	7.833	0	(35)	(35)	(0,01)
						$ 3.518	$ (6.139)	$ (2.621)	(0,64)

ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklasse Institutional CHF (Partially Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung		Zu erhaltende Währung		Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
AZD	07.2023	AUD	139	$	91	$ 0	$ (2)	$ (2)	0,00
	07.2023	$	275	AUD	414	1	0	1	0,00
	08.2023	AUD	414	$	275	0	(1)	(1)	0,00
BOA	07.2023		780		509	0	(11)	(11)	0,00
	07.2023	CAD	3.534		2.597	0	(73)	(73)	(0,02)
	07.2023	DKK	913		132	0	(2)	(2)	0,00
	07.2023	¥	23.717		171	6	0	6	0,00
	07.2023	NOK	3.380		308	0	(8)	(8)	0,00
	07.2023	NZD	176		107	0	(1)	(1)	0,00
	07.2023	SEK	62		6	0	0	0	0,00
	07.2023	$	244	DKK	1.656	0	(1)	(1)	0,00
	08.2023	DKK	1.654	$	244	1	0	1	0,00
BPS	07.2023	CHF	34.850		38.967	13	0	13	0,00
	07.2023	DKK	3		0	0	0	0	0,00
	07.2023	¥	1.051.337		7.567	293	0	293	0,07
	07.2023	NZD	16		10	0	0	0	0,00
	07.2023	$	196	AUD	296	1	0	1	0,00

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung		Zu erhaltende Währung		Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
	07.2023	$	16.017	CHF	14.480	$ 168	$ 0	$ 168	0,04
	07.2023		24.352	€	22.225	0	(104)	(104)	(0,03)
	07.2023		74	NOK	791	0	0	0	0,00
	08.2023	AUD	296	$	196	0	(1)	(1)	0,00
	08.2023	€	22.225		24.386	105	0	105	0,02
	08.2023	NOK	790		74	0	0	0	0,00
	08.2023	$	38.967	CHF	34.751	0	(13)	(13)	0,00
CBK	07.2023	NOK	147	$	13	0	(1)	(1)	0,00
CLY	07.2023	CHF	18.420		20.506	0	(83)	(83)	(0,02)
	07.2023	DKK	2.682		387	0	(6)	(6)	0,00
	08.2023	$	20.506	CHF	18.367	83	0	83	0,02
GLM	07.2023		452	NOK	4.876	3	0	3	0,00
	08.2023	NOK	4.871	$	452	0	(3)	(3)	0,00
JPM	07.2023	$	2.560	¥	366.105	0	(27)	(27)	(0,01)
	08.2023	¥	364.550	$	2.560	27	0	27	0,01
MBC	07.2023	CAD	2		1	0	0	0	0,00
	07.2023	£	3.552		4.397	0	(119)	(119)	(0,03)
	07.2023	SEK	115		11	0	0	0	0,00
	07.2023	$	1.022	CHF	928	16	0	16	0,00
MYI	07.2023	CHF	677	$	748	0	(9)	(9)	0,00
	07.2023	SEK	8.874		827	5	0	5	0,00
	07.2023	$	217	DKK	1.477	0	0	0	0,00
	07.2023		840	SEK	9.065	0	0	0	0,00
	08.2023	DKK	1.475	$	217	0	0	0	0,00
	08.2023	SEK	9.054		840	0	0	0	0,00
SCX	07.2023	AUD	821		537	0	(10)	(10)	0,00
	07.2023	NZD	460		279	0	(2)	(2)	0,00
	07.2023	$	404	AUD	608	1	0	1	0,00
	07.2023		36.854	CHF	33.114	160	0	160	0,04
	08.2023	AUD	608	$	404	0	(1)	(1)	0,00
SOG	07.2023		920		602	0	(10)	(10)	0,00
	07.2023	€	22.225		23.908	0	(339)	(339)	(0,08)
TOR	07.2023	AUD	487		319	0	(6)	(6)	0,00
	07.2023	$	494	AUD	748	4	0	4	0,00
	07.2023		2.672	CAD	3.536	2	(2)	0	0,00
	07.2023		4.514	£	3.552	2	0	2	0,00
	07.2023		4.923	¥	708.899	0	(18)	(18)	0,00
	07.2023		397	NZD	652	2	0	2	0,00
	08.2023	AUD	748	$	495	0	(4)	(4)	0,00
	08.2023	CAD	3.535		2.672	2	(2)	0	0,00
	08.2023	£	3.552		4.515	0	(2)	(2)	0,00
	08.2023	¥	705.893		4.923	18	0	18	0,00
	08.2023	NZD	652		397	0	(2)	(2)	0,00
UAG	07.2023	AUD	111		73	0	(1)	(1)	0,00
	07.2023	CHF	24.332		27.143	0	(54)	(54)	(0,01)
	07.2023	NOK	2.365		214	0	(7)	(7)	0,00
	07.2023	$	797	AUD	1.193	2	(4)	(2)	0,00
	07.2023		33.657	CHF	30.242	146	0	146	0,03
	08.2023	AUD	1.193	$	797	5	(2)	3	0,00
	08.2023	$	27.143	CHF	24.263	53	0	53	0,01
						$ 1.119	$ (931)	$ 188	0,04

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklassen Institutional EUR (Partially Hedged) thesaurierend und E Class EUR (Partially Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung		Zu erhaltende Währung		Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
AZD	07.2023	AUD	184	$	120	$ 0	$ (2)	$ (2)	0,00
	07.2023	$	531	AUD	800	2	0	2	0,00
	08.2023	AUD	800	$	531	0	(2)	(2)	0,00
BOA	07.2023		1.400		913	0	(19)	(19)	(0,01)
	07.2023	CAD	6.667		4.900	0	(139)	(139)	(0,03)
	07.2023	DKK	1.698		245	0	(4)	(4)	0,00
	07.2023	€	26		28	0	0	0	0,00
	07.2023	NOK	6.187		563	0	(15)	(15)	0,00
	07.2023	NZD	221		134	0	(1)	(1)	0,00
	07.2023	SEK	115		11	0	0	0	0,00
	07.2023	$	453	DKK	3.083	0	(2)	(2)	0,00
	07.2023		10	¥	1.395	0	0	0	0,00
	08.2023	DKK	3.078	$	453	2	0	2	0,00
BPS	07.2023	CHF	10		11	0	0	0	0,00
	07.2023	DKK	6		1	0	0	0	0,00
	07.2023	€	69.251		75.878	325	0	325	0,08
	07.2023	¥	1.938.587		13.953	541	0	541	0,13
	07.2023	NZD	20		12	0	0	0	0,00
	07.2023	$	379	AUD	572	2	0	2	0,00
	07.2023		2.120	CHF	1.896	0	(1)	(1)	0,00
	07.2023		42.547	€	39.569	623	0	623	0,15
	07.2023		135	NOK	1.447	0	0	0	0,00
	08.2023	AUD	572	$	379	0	(2)	(2)	0,00
	08.2023	CHF	1.891		2.120	1	0	1	0,00

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung		Zu erhaltende Währung		Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
	08.2023	NOK	1.446	$	135	$ 0	$ 0	$ 0	0,00
	08.2023	$	75.982	€	69.249	0	(330)	(330)	(0,08)
CBK	07.2023	€	51	$	55	0	(1)	(1)	0,00
	07.2023	NOK	269		24	0	(1)	(1)	0,00
CLY	07.2023	DKK	4.991		720	0	(11)	(11)	0,00
	07.2023	$	53	CHF	48	0	0	0	0,00
	08.2023	CHF	48	$	53	0	0	0	0,00
GLM	07.2023	$	828	NOK	8.924	5	0	5	0,00
	08.2023	NOK	8.915	$	828	0	(5)	(5)	0,00
JPM	07.2023	AUD	1.123		734	0	(13)	(13)	0,00
	07.2023	€	38.737		42.297	35	0	35	0,01
	07.2023	$	4.613	¥	659.703	0	(49)	(49)	(0,01)
	08.2023	¥	656.900	$	4.613	49	0	49	0,01
	08.2023	$	42.356	€	38.737	0	(36)	(36)	(0,01)
MBC	07.2023	CAD	3	$	3	0	0	0	0,00
	07.2023	€	25		27	0	0	0	0,00
	07.2023	£	6.706		8.301	0	(225)	(225)	(0,06)
	07.2023	SEK	214		20	0	0	0	0,00
	07.2023	$	474	£	381	10	0	10	0,00
MYI	07.2023	CHF	14	$	16	0	0	0	0,00
	07.2023	SEK	16.512		1.538	10	0	10	0,00
	07.2023	$	403	DKK	2.749	0	0	0	0,00
	07.2023		1.562	SEK	16.867	0	(1)	(1)	0,00
	08.2023	DKK	2.745	$	403	0	0	0	0,00
	08.2023	SEK	16.846		1.562	1	0	1	0,00
SCX	07.2023	AUD	1.585		1.036	0	(19)	(19)	(0,01)
	07.2023	CHF	1.847		2.056	0	(9)	(9)	0,00
	07.2023	NZD	576		349	0	(3)	(3)	0,00
	07.2023	$	780	AUD	1.174	2	0	2	0,00
	08.2023	AUD	1.174	$	780	0	(2)	(2)	0,00
SOG	07.2023		1.213		794	0	(14)	(14)	0,00
	07.2023	$	73.708	€	68.519	1.047	0	1.047	0,25
TOR	07.2023	AUD	642	$	420	0	(7)	(7)	0,00
	07.2023	$	955	AUD	1.445	7	0	7	0,00
	07.2023		5.041	CAD	6.671	4	(4)	0	0,00
	07.2023		8.037	£	6.325	4	0	4	0,00
	07.2023		8.871	¥	1.277.400	0	(33)	(33)	(0,01)
	07.2023		497	NZD	817	3	0	3	0,00
	08.2023	AUD	1.445	$	955	0	(7)	(7)	0,00
	08.2023	CAD	6.668		5.041	3	(3)	0	0,00
	08.2023	£	6.325		8.039	0	(4)	(4)	0,00
	08.2023	¥	1.271.983		8.871	33	0	33	0,01
	08.2023	NZD	817		497	0	(3)	(3)	0,00
UAG	07.2023	AUD	147		96	0	(2)	(2)	0,00
	07.2023	CHF	120		134	0	(1)	(1)	0,00
	07.2023	NOK	4.327		391	0	(13)	(13)	0,00
	07.2023	$	1.538	AUD	2.303	3	(8)	(5)	0,00
	07.2023		52	CHF	47	0	0	0	0,00
	08.2023	AUD	2.303	$	1.539	8	(3)	5	0,00
	08.2023	CHF	47		52	0	0	0	0,00
						$ 2.720	$ (994)	$ 1.726	0,42

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklasse Institutional NOK (Partially Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung		Zu erhaltende Währung		Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
AZD	07.2023	AUD	46	$	30	$ 0	$ (1)	$ (1)	0,00
	07.2023	$	132	AUD	199	0	0	0	0,00
	08.2023	AUD	199	$	132	0	0	0	0,00
BOA	07.2023		348		227	0	(5)	(5)	0,00
	07.2023	CAD	1.667		1.225	0	(35)	(35)	(0,01)
	07.2023	DKK	451		65	0	(1)	(1)	0,00
	07.2023	£	85		106	0	(1)	(1)	0,00
	07.2023	¥	16.698		119	3	0	3	0,00
	07.2023	NZD	69		42	0	0	0	0,00
	07.2023	SEK	29		3	0	0	0	0,00
	07.2023	$	120	DKK	818	0	0	0	0,00
	07.2023		111	¥	15.429	0	(4)	(4)	0,00
	07.2023		16.898	NOK	186.026	466	0	466	0,11
	07.2023		388	SEK	4.190	0	0	0	0,00
	08.2023	DKK	817	$	120	0	0	0	0,00
	08.2023	SEK	4.185		388	0	0	0	0,00
BPS	07.2023	CHF	2		3	0	0	0	0,00
	07.2023	DKK	2		0	0	0	0	0,00
	07.2023	€	129		141	0	0	0	0,00
	07.2023	¥	496.394		3.573	138	0	138	0,03
	07.2023	NOK	56.578		5.263	0	(18)	(18)	0,00
	07.2023	NZD	6		4	0	0	0	0,00
	07.2023	$	94	AUD	142	0	0	0	0,00
	07.2023		534	CHF	478	0	0	0	0,00
	07.2023		11.428	€	10.430	0	(49)	(49)	(0,01)

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung		Zu erhaltende Währung		Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
	08.2023	AUD	142	$	94	$ 0	$ (1)	$ (1)	0,00
	08.2023	CHF	476		534	0	0	0	0,00
	08.2023	€	10.430		11.444	49	0	49	0,01
	08.2023	$	5.263	NOK	56.523	19	0	19	0,00
CBK	07.2023	NOK	2.838	$	255	0	(9)	(9)	0,00
	07.2023	$	413	€	385	7	0	7	0,00
	07.2023		6.515	NOK	73.265	323	0	323	0,08
CLY	07.2023	DKK	1.324	$	191	0	(3)	(3)	0,00
	07.2023	$	13	CHF	12	0	0	0	0,00
	08.2023	CHF	12	$	13	0	0	0	0,00
GLM	07.2023	NOK	166.319		15.431	0	(94)	(94)	(0,02)
	08.2023	$	15.431	NOK	166.156	94	0	94	0,02
JPM	07.2023	AUD	279	$	182	0	(3)	(3)	0,00
	07.2023	$	1.185	¥	169.477	0	(13)	(13)	0,00
	08.2023	¥	168.757	$	1.185	13	0	13	0,00
MBC	07.2023	CAD	1		1	0	0	0	0,00
	07.2023	€	390		421	0	(4)	(4)	0,00
	07.2023	£	1.648		2.040	0	(55)	(55)	(0,01)
	07.2023	SEK	53		5	0	0	0	0,00
	07.2023	$	126	£	101	3	0	3	0,00
MYI	07.2023	CHF	4	$	4	0	0	0	0,00
	07.2023	SEK	4.103		382	2	0	2	0,00
	07.2023	$	107	DKK	730	0	0	0	0,00
	08.2023	DKK	728	$	107	0	0	0	0,00
SCX	07.2023	AUD	394		257	0	(5)	(5)	0,00
	07.2023	CHF	465		518	0	(2)	(2)	0,00
	07.2023	NZD	179		108	0	(1)	(1)	0,00
	07.2023	$	194	AUD	292	1	0	1	0,00
	08.2023	AUD	292	$	194	0	(1)	(1)	0,00
SOG	07.2023		301		197	0	(3)	(3)	0,00
	07.2023	€	10.297		11.077	0	(158)	(158)	(0,04)
TOR	07.2023	AUD	159		104	0	(2)	(2)	0,00
	07.2023	$	237	AUD	359	2	0	2	0,00
	07.2023		1.261	CAD	1.668	1	(1)	0	0,00
	07.2023		2.073	£	1.631	1	0	1	0,00
	07.2023		2.279	¥	328.163	0	(8)	(8)	0,00
	07.2023		154	NZD	253	1	0	1	0,00
	08.2023	AUD	359	$	237	0	(2)	(2)	0,00
	08.2023	CAD	1.668		1.261	1	(1)	0	0,00
	08.2023	£	1.631		2.074	0	(1)	(1)	0,00
	08.2023	¥	326.772		2.279	8	0	8	0,00
	08.2023	NZD	253		154	0	(1)	(1)	0,00
UAG	07.2023	AUD	37		24	0	0	0	0,00
	07.2023	CHF	30		34	0	0	0	0,00
	07.2023	$	382	AUD	572	1	(2)	(1)	0,00
	07.2023		13	CHF	12	0	0	0	0,00
	07.2023		16.091	NOK	178.058	530	0	530	0,13
	08.2023	AUD	572	$	382	2	(1)	1	0,00
	08.2023	CHF	12		13	0	0	0	0,00
						$ 1.665	$ (485)	$ 1.180	0,29
Summe Freiverkehrsfinanzderivate								**$ 91**	**0,02**

LEERVERKAUFTE WERTPAPIERE

BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
US-REGIERUNGSBEHÖRDEN			
Uniform Mortgage-Backed Security, TBA			
2,000 % fällig am 01.07.2038	$ 7.000	$ (6.204)	(1,51)
2,000 % fällig am 01.08.2053	27.750	(22.669)	(5,50)
Summe Leerverkaufte Wertpapiere		**$ (28.873)**	**(7,01)**
Summe Anlagen		**$ 511.771**	**124,33**
Sonstige Aktiva und Passiva		**$ (100.156)**	**(24,33)**
Nettovermögen		**$ 411.615**	**100,00**

ERLÄUTERUNGEN ZUR AUFSTELLUNG DES WERTPAPIERBESTANDS (Angaben in Tausend*):

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

^ Das Wertpapier ist in Verzug.

(a) Bei dem Wertpapier handelt es sich um ein Interest Only- („IO“) bzw. IO-Strip.

(b) Das Wertpapier hat in den letzten zwölf Monaten keine Erträge geliefert.

(c) Nullkuponwertpapier.

(d) Der Kupon stellt eine Rendite bis zur Endfälligkeit dar.

(e) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

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

(g) Mit dem Fonds verbunden.

(h) Bedingt wandelbares Wertpapier.

(i) Eingeschränkte Wertpapiere (31. Dezember 2022: 0,46 %):

Emittentenbeschreibung	Kauf-datum	Kosten	Markt-wert	% des Nettovermögens
Deutsche Bank AG 3,035 %, fällig am 28.05.2032	21.06.2021	$ 1.062	$ 828	0,20
DrillCo Holding Lux S.A.	08.06.2023	321	308	0,08
		$ 1.383	$ 1.136	0,28

Wertpapier mit einem gesamten beizulegenden Zeitwert von null USD (31. Dezember 2022: 1.525 USD) wurden zum 30. Juni 2023 gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen als Sicherheit für Pensionsgeschäfte verpfändet.

Barmittel in Höhe von 14.781 USD (31. Dezember 2022: 13.884 USD) wurden zum 30. Juni 2023 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Barmittel in Höhe von 2.840 USD (31. Dezember 2022: 1.120 USD) wurden zum 30. Juni 2023 gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. als Sicherheit für Finanzderivate verpfändet.

Beizulegender Zeitwert[1]

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 30. Juni 2023 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie[2]	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	$ 0	$ 517.946	$ 834	$ 518.780
Investmentfonds	21.489	0	0	21.489
Pensionsgeschäfte	0	2.347	0	2.347
Finanzderivate[3]	812	(2.784)	0	(1.972)
Leerverkaufte Wertpapiere	0	(28.873)	0	(28.873)
Summen	**$ 22.301**	**$ 488.636**	**$ 834**	**$ 511.771**

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

Kategorie[2]	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	$ 0	$ 442.801	$ 831	$ 443.632
Investmentfonds	18.242	0	0	18.242
Pensionsgeschäfte	0	1.408	0	1.408
Finanzderivate[3]	4.652	(41)	0	4.611
Leerverkaufte Wertpapiere	0	(28.813)	0	(28.813)
Summen	**$ 22.894**	**$ 415.355**	**$ 831**	**$ 439.080**

(1) Weitere Informationen finden Sie in den Erläuterungen in Erläuterung 3.

(2) Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung des Wertpapierbestands.

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

Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC-Finanzderivate und -Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2023 und 31. Dezember 2022:

	Zum 30. Jun. 2023			Zum 31. Dez. 2022		
Kontrahent	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-engagement[1]	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-engagement[1]
AZD	$ (4)	$ 10	$ 6	$ 7	$ 0	$ 7
BOA	(437)	580	143	1.000	(730)	270
BOM	k. A.	k. A.	k. A.	24	0	24
BPS	1.305	(1.250)	55	(629)	560	(69)
BRC	(69)	60	(9)	272	0	272
BSH	8	0	8	3	0	3
CBK	(355)	310	(45)	1.063	(1.120)	(57)
CLY	(73)	0	(73)	(8)	0	(8)
DUB	601	(460)	141	(125)	20	(105)
FAR	(10)	0	(10)	k. A.	k. A.	k. A.
GLM	(216)	0	(216)	150	(370)	(220)
GST	k. A.	k. A.	k. A.	4	0	4
HUS	k. A.	k. A.	k. A.	(4)	0	(4)
IND	k. A.	k. A.	k. A.	110	0	110
JPM	(389)	280	(109)	1.248	(760)	488
MBC	(282)	140	(142)	264	(90)	174
MYC	(8)	0	(8)	(5)	0	(5)
MYI	(461)	290	(171)	(909)	540	(369)
RBC	670	(660)	10	116	0	116

	Zum 30. Jun. 2023			Zum 31. Dez. 2022		
Kontrahent	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-engagement[1]	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-engagement[1]
RYL	$ k. A.	$ k. A.	$ k. A.	$ (2)	$ 0	$ (2)
SCX	(1.022)	830	(192)	992	(910)	82
SOG	660	(510)	150	77	(70)	7
SSB	14	0	14	k. A.	k. A.	k. A.
TOR	(453)	340	(113)	6	0	6
UAG	612	(410)	202	85	0	85

[1] Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären.

Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung des Wertpapierbestands zum 30. Juni 2023:

	30. Jun. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	89,34	65,89
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	36,58	41,33
Sonstige übertragbare Wertpapiere	0,11	0,88
Investmentfonds	5,22	4,44
Pensionsgeschäfte	0,57	0,34
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	0,33	1,08
Zentral abgerechnete Finanzderivate	(0,83)	(0,87)
Freiverkehrsfinanzderivate	0,02	0,91
Leerverkaufte Wertpapiere	(7,01)	(7,03)
Umgekehrte Pensionsgeschäfte	k. A.	(0,37)

Das Anlageportfolio des Fonds konzentriert sich zum 30. Juni 2023 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	30. Jun. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
Argentinien	0,02	0,02
Australien	1,65	1,74
Brasilien	0,69	0,76
Bulgarien	0,55	k. A.
Kanada	0,67	0,73
Cayman Inseln	5,60	5,78
Chile	0,59	0,56
China	0,07	k. A.
Kolumbien	0,48	0,02
Tschechische Republik	0,11	0,10
Dänemark	2,62	2,67
Dominikanische Republik	0,17	0,16
Frankreich	2,99	2,83
Deutschland	2,13	2,33
Guatemala	0,09	0,10
Hongkong	0,10	0,21
Ungarn	1,03	0,03
Indonesien	1,16	1,10
Irland	5,34	5,34
Israel	1,21	0,98
Italien	7,56	7,32
Elfenbeinküste	0,51	0,35
Japan	5,88	4,40
Kasachstan	0,42	k. A.
Luxemburg	1,07	0,67
Malaysia	0,24	0,98
Mexiko	k. A.	0,28
Marokko	k. A.	0,37
Multinational	0,24	0,25
Niederlande	1,30	1,59
Neuseeland	0,07	0,07
Norwegen	0,19	0,20
Peru	0,26	1,68
Philippinen	0,09	0,08
Polen	0,77	0,03
Portugal	0,16	0,09
Katar	0,08	0,08
Rumänien	0,92	0,63
Russland	0,31	0,20
Saudi-Arabien	0,85	k. A.
Serbien	0,66	0,88
Singapur	0,31	0,20
Slowenien	0,19	0,18
Südafrika	0,09	0,09
Südkorea	2,18	0,78
Spanien	1,05	1,04
Supranational	0,72	0,71
Schweiz	1,44	1,64
Thailand	k. A.	0,26
Vereinigte Arabische Emirate	0,05	0,05
Großbritannien	8,00	9,05
Vereinigte Staaten	62,35	45,54

Anlagen zum Marktwert	30. Jun. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
Kurzfristige Instrumente	0,80	2,95
Investmentfonds	5,22	4,44
Pensionsgeschäfte	0,57	0,34
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	0,34	1,09
Verkaufsoptionen		
Optionen auf börsengehandelte Terminkontrakte	(0,01)	(0,01)
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	0,00	0,00
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzkauf	(0,17)	(0,15)
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzverkauf	0,05	0,00
Zinsswaps — Basisswaps	k. A.	0,01
Zinsswaps	(0,71)	(0,73)
Freiverkehrsfinanzderivate		
Optionskauf		
Zinsswapoptionen	0,05	0,05
Optionen auf Wertpapiere	0,08	0,08
Verkaufsoptionen		
Zinsswapoptionen	(0,24)	(0,27)
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzkauf	k. A.	(0,01)
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	0,00	0,01
Cross-Currency Swaps	0,00	0,00
Zinsswaps	0,02	0,00
Devisenterminkontrakte	(0,64)	0,37
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	0,75	0,68
Leerverkaufte Wertpapiere	(7,01)	(7,03)
Sonstige Aktiva und Passiva	(24,33)	(06,97)
Nettovermögen	100,00	100,00

BESCHREIBUNG		PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE				
AUSTRALIEN				
FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE				
Pepper SPARKZ Trust				
5,160 % fällig am 17.08.2028	AUD	3.783	$ 2.517	0,02
NON-AGENCY-MBS				
Interstar Millennium Trust				
4,530 % fällig am 27.03.2038		7	4	0,00
RESIMAC Bastille Trust				
6,093 % fällig am 05.09.2057	$	1.242	1.242	0,01
			1.246	0,01
STAATSEMISSIONEN				
Australia Government International Bond				
0,500 % fällig am 21.09.2026	AUD	146.900	87.513	0,69
1,000 % fällig am 21.12.2030		14.400	7.748	0,06
1,250 % fällig am 21.05.2032		13.600	7.195	0,06
1,750 % fällig am 21.06.2051		16.900	6.552	0,05
2,500 % fällig am 21.05.2030		17.800	10.800	0,09
4,500 % fällig am 21.04.2033		63.300	43.746	0,35
			163.554	1,30
Summe Australien			167.317	1,33
KANADA				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Fairfax Financial Holdings Ltd.				
2,750 % fällig am 29.03.2028	€	15.200	14.940	0,12
NON-AGENCY-MBS				
Real Estate Asset Liquidity Trust				
3,650 % fällig am 12.08.2053	CAD	7.100	5.059	0,04
STAATSEMISSIONEN				
Canada Government International Bond				
2,000 % fällig am 01.06.2028		650	458	0,00
Canadian Government Real Return Bond				
1,500 % fällig am 01.12.2044 (e)		10.550	7.979	0,06
CPPIB Capital, Inc.				
0,750 % fällig am 02.02.2037	€	2.200	1.699	0,01
Ontario Teachers' Finance Trust				
0,900 % fällig am 20.05.2041		9.700	6.927	0,06
Province of Ontario				
0,010 % fällig am 25.11.2030		30.200	25.820	0,21
			42.883	0,34
Summe Kanada			62.882	0,50
CAYMAN INSELN				
FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE				
Apidos CLO				
6,340 % fällig am 15.04.2031	$	4.500	4.455	0,04
6,420 % fällig am 20.10.2031		12.240	12.116	0,10
Atlas Senior Loan Fund Ltd.				
6,410 % fällig am 16.01.2030		8.702	8.660	0,07
Benefit Street Partners CLO Ltd.				
6,340 % fällig am 20.04.2031		8.370	8.268	0,07
BlueMountain CLO Ltd.				
6,340 % fällig am 15.07.2031		8.250	8.142	0,06
Carbone CLO Ltd.				
6,390 % fällig am 20.01.2031		6.805	6.759	0,05
Carlyle Global Market Strategies CLO Ltd.				
6,360 % fällig am 15.10.2030		2.786	2.774	0,02
6,371 % fällig am 15.05.2031		5.938	5.872	0,05
Catamaran CLO Ltd.				
6,373 % fällig am 22.04.2030		22.846	22.709	0,18
CBAM Ltd.				
6,500 % fällig am 20.07.2030		17.337	17.272	0,14
Deer Creek CLO Ltd.				
6,430 % fällig am 20.10.2030		4.578	4.547	0,04
Dryden Senior Loan Fund				
6,230 % fällig am 15.04.2031		10.400	10.318	0,08
Gallatin CLO Ltd.				
6,311 % fällig am 21.01.2028		3.734	3.730	0,03
ICG U.S. CLO Ltd.				
6,353 % fällig am 22.07.2031	$	13.700	$ 13.545	0,11
Marble Point CLO Ltd.				
6,442 % fällig am 18.12.2030		14.688	14.476	0,11
Midocean Credit CLO				
6,385 % fällig am 19.07.2028		1.507	1.508	0,01
OZLM Ltd.				
6,348 % fällig am 16.05.2030		6.812	6.765	0,05
6,400 % fällig am 20.01.2031		3.720	3.684	0,03
Palmer Square CLO Ltd.				
6,390 % fällig am 17.01.2031		3.407	3.385	0,03
Regatta Funding Ltd.				
6,510 % fällig am 17.10.2030		7.848	7.815	0,06
Sound Point CLO Ltd.				
6,368 % fällig am 26.07.2031		1.200	1.179	0,01
Venture CLO Ltd.				
6,140 % fällig am 15.04.2027		1.456	1.451	0,01
			169.430	1,35
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Avolon Holdings Funding Ltd.				
2,528 % fällig am 18.11.2027		431	364	0,00
Gaci First Investment Co.				
4,750 % fällig am 14.02.2030		23.000	22.668	0,18
4,875 % fällig am 14.02.2035		22.100	21.216	0,17
5,125 % fällig am 14.02.2053		14.400	12.978	0,10
KSA Sukuk Ltd.				
5,268 % fällig am 25.10.2028		8.500	8.690	0,07
QNB Finance Ltd.				
1,375 % fällig am 26.01.2026		2.060	1.868	0,02
Sands China Ltd.				
5,625 % fällig am 08.08.2025		4.100	4.002	0,03
5,900 % fällig am 08.08.2028		9.300	8.874	0,07
Tencent Holdings Ltd.				
3,595 % fällig am 19.01.2028		8.500	7.915	0,06
			88.575	0,70
Summe Cayman Inseln			258.005	2,05
CHINA				
STAATSEMISSIONEN				
China Government International Bond				
3,190 % fällig am 15.04.2053	CNY	61.240	8.736	0,07
TSCHECHISCHE REPUBLIK				
STAATSEMISSIONEN				
Czech Republic Government International Bond				
2,500 % fällig am 25.08.2028	CZK	2.900	121	0,00
DÄNEMARK				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Jyske Realkredit A/S				
1,000 % fällig am 01.10.2050	DKK	505.214	50.931	0,40
1,500 % fällig am 01.10.2037		0	0	0,00
1,500 % fällig am 01.07.2050		0	0	0,00
1,500 % fällig am 01.10.2050		0	0	0,00
2,000 % fällig am 01.10.2047		0	0	0,00
2,000 % fällig am 01.10.2050		0	0	0,00
2,500 % fällig am 01.10.2047		0	0	0,00
Nordea Kredit Realkreditaktieselskab				
1,000 % fällig am 01.10.2050		611.150	61.309	0,49
1,500 % fällig am 01.10.2037		0	0	0,00
1,500 % fällig am 01.10.2050		0	0	0,00
1,500 % fällig am 01.10.2053		40.389	4.459	0,03
2,000 % fällig am 01.10.2037		0	0	0,00
2,000 % fällig am 01.10.2047		0	0	0,00
2,000 % fällig am 01.10.2050		0	0	0,00
2,500 % fällig am 01.10.2037		0	0	0,00
2,500 % fällig am 01.10.2047		0	0	0,00
Nykredit Realkredit A/S				
1,000 % fällig am 01.10.2050		1.259.811	129.747	1,03
1,000 % fällig am 01.10.2053		0	0	0,00
1,500 % fällig am 01.10.2037		0	0	0,00
1,500 % fällig am 01.10.2050		0	0	0,00
1,500 % fällig am 01.10.2053		8.153	899	0,01
2,000 % fällig am 01.10.2047		0	0	0,00
2,000 % fällig am 01.10.2050		0	0	0,00
2,500 % fällig am 01.10.2036	DKK	0	$ 0	0,00
2,500 % fällig am 01.10.2047		0	0	0,00
3,000 % fällig am 01.10.2047		0	0	0,00
5,000 % fällig am 01.10.2053		249.403	35.995	0,28
Realkredit Danmark A/S				
1,000 % fällig am 01.10.2050		117.711	12.401	0,10
1,000 % fällig am 01.10.2053		35.087	3.656	0,03
1,500 % fällig am 01.10.2053		8.549	943	0,01
2,000 % fällig am 01.10.2050		0	0	0,00
2,500 % fällig am 01.04.2036		0	0	0,00
2,500 % fällig am 01.04.2047		0	0	0,00
3,000 % fällig am 01.07.2046		0	0	0,00
4,797 % fällig am 01.01.2038		0	0	0,00
Summe Dänemark			300.340	2,38
FINNLAND				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Nordea Kiinnitysluottopankki Oyj				
0,625 % fällig am 23.05.2025	€	1.000	1.028	0,01
FRANKREICH				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
BNP Paribas S.A.				
2,219 % fällig am 09.06.2026	$	5.200	4.812	0,04
Dexia Credit Local S.A.				
0,000 % fällig am 21.01.2028 (c)	€	9.100	8.532	0,07
0,500 % fällig am 17.01.2025		2.300	2.385	0,02
Societe Generale S.A.				
1,488 % fällig am 14.12.2026	$	21.700	19.108	0,15
2,226 % fällig am 21.01.2026		24.200	22.487	0,18
2,797 % fällig am 19.01.2028		17.500	15.517	0,12
6,221 % fällig am 15.06.2033		13.800	12.859	0,10
6,446 % fällig am 10.01.2029		3.100	3.108	0,02
6,691 % fällig am 10.01.2034		12.200	12.429	0,10
			101.237	0,80
STAATSEMISSIONEN				
France Government International Bond				
0,500 % fällig am 25.06.2044	€	6.750	4.365	0,03
0,500 % fällig am 25.05.2072		15.250	6.555	0,05
0,750 % fällig am 25.05.2052		115.450	68.689	0,55
2,000 % fällig am 25.05.2048		73.081	63.069	0,50
3,250 % fällig am 25.05.2045		19.100	20.910	0,17
			163.588	1,30
Summe Frankreich			264.825	2,10
DEUTSCHLAND				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Aareal Bank AG				
0,625 % fällig am 14.02.2025	$	800	737	0,01
Deutsche Bank AG				
0,050 % fällig am 20.11.2024	€	19.600	20.236	0,16
1,000 % fällig am 19.11.2025		400	412	0,00
1,375 % fällig am 03.09.2026		32.100	32.194	0,26
1,375 % fällig am 17.02.2032		14.300	11.576	0,09
1,625 % fällig am 20.01.2027		54.400	52.781	0,42
1,750 % fällig am 19.11.2030		20.500	17.699	0,14
1,875 % fällig am 23.02.2028		5.900	5.704	0,05
2,625 % fällig am 16.12.2024	£	23.600	27.926	0,22
3,547 % fällig am 18.09.2031	$	12.700	10.555	0,08
3,729 % fällig am 14.01.2032 (h)		2.000	1.514	0,01
3,961 % fällig am 26.11.2025		26.750	25.519	0,20
4,100 % fällig am 13.01.2026		1.800	1.686	0,01
6,119 % fällig am 14.07.2026		19.300	19.092	0,15
IHO Verwaltungs GmbH (3,750 % bar oder 4,500 % PIK)				
3,750 % fällig am 15.09.2026 (b)	€	12.050	12.299	0,10
Kreditanstalt fuer Wiederaufbau				
5,000 % fällig am 19.03.2024	AUD	1.500	1.001	0,01
Summe Deutschland			240.931	1,91
HONGKONG				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Huarong Finance Co. Ltd.				
2,125 % fällig am 30.09.2023	$	14.200	14.035	0,11
Vanke Real Estate Hong Kong Co. Ltd.				
3,150 % fällig am 12.05.2025		8.300	7.750	0,06
Summe Hongkong			21.785	0,17

BESCHREIBUNG		PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
UNGARN				
STAATSEMISSIONEN				
Hungary Government International Bond				
3,000 % fällig am 27.10.2027	HUF	117.500	$ 286	0,00
5,000 % fällig am 22.02.2027	€	4.100	4.507	0,04
6,250 % fällig am 22.09.2032	$	17.200	17.665	0,14
7,625 % fällig am 29.03.2041		100	113	0,00
Summe Ungarn			22.571	0,18
INTERNATIONALE KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG				
Project Mercury				
TBD % fällig am 17.07.2030	€	25.000	27.275	0,22
IRLAND				
FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE				
Accunia European CLO DAC				
4,127 % fällig am 15.07.2030		5.003	5.389	0,04
Adagio CLO DAC				
3,897 % fällig am 15.10.2031		10.250	10.968	0,09
Aqueduct European CLO DAC				
3,840 % fällig am 20.07.2030		11.521	12.407	0,10
Ares European CLO				
3,837 % fällig am 15.10.2030		8.148	8.724	0,07
Ares European CLO DAC				
3,787 % fällig am 15.04.2030		6.983	7.472	0,06
3,837 % fällig am 15.10.2030		7.453	7.979	0,06
3,957 % fällig am 15.10.2031		24.100	25.843	0,20
4,050 % fällig am 20.04.2032		9.100	9.742	0,08
Armada Euro CLO DAC				
3,897 % fällig am 15.07.2031		8.996	9.602	0,08
Aurium CLO DAC				
3,907 % fällig am 16.01.2031		28.758	30.772	0,24
Avoca CLO DAC				
3,997 % fällig am 15.10.2032		9.800	10.452	0,08
Bain Capital Euro CLO DAC				
3,940 % fällig am 20.01.2032		12.427	13.260	0,11
Black Diamond CLO DAC				
4,303 % fällig am 15.05.2032		5.400	5.764	0,05
Blackrock European CLO DAC				
3,797 % fällig am 15.10.2031		10.800	11.513	0,09
BlueMountain Fuji EUR CLO DAC				
3,897 % fällig am 15.01.2031		11.184	11.956	0,09
BNPP AM Euro CLO DAC				
4,031 % fällig am 22.07.2032		12.700	13.539	0,11
Cairn CLO BV				
3,957 % fällig am 15.10.2031		16.400	17.538	0,14
Carlyle Euro CLO DAC				
3,953 % fällig am 15.08.2030		6.384	6.809	0,05
4,213 % fällig am 15.08.2032		3.200	3.413	0,03
Carlyle Global Market Strategies Euro CLO Ltd.				
4,073 % fällig am 15.11.2031		11.500	12.310	0,10
Contego CLO DAC				
3,851 % fällig am 23.01.2030		6.283	6.719	0,05
CVC Cordatus Loan Fund DAC				
3,855 % fällig am 21.07.2030		20.933	22.461	0,18
Dryden Euro CLO DAC				
3,837 % fällig am 15.04.2033		6.600	7.044	0,06
4,183 % fällig am 15.05.2034		23.450	25.036	0,20
Griffith Park CLO DAC				
4,103 % fällig am 21.11.2031		14.300	15.307	0,12
Harvest CLO DAC				
3,880 % fällig am 20.10.2031		15.500	16.566	0,13
3,937 % fällig am 15.07.2031		9.850	10.488	0,08
4,027 % fällig am 15.01.2032		22.300	23.808	0,19
4,250 % fällig am 26.06.2030		8.818	9.427	0,07
Jubilee CLO DAC				
3,777 % fällig am 15.04.2030		20.800	22.168	0,18
3,827 % fällig am 15.04.2031		1.100	1.170	0,01
4,326 % fällig am 15.12.2029		1.511	1.630	0,01
Laurelin DAC				
3,920 % fällig am 20.10.2031		15.000	16.070	0,13
Madison Park Euro Funding DAC				
3,927 % fällig am 15.01.2032		22.900	24.461	0,19
3,977 % fällig am 15.07.2032		7.300	7.768	0,06
Man GLG Euro CLO DAC				
3,987 % fällig am 15.10.2032	€	10.288	$ 10.934	0,09
Oak Hill European Credit Partners DAC				
3,940 % fällig am 20.10.2031		24.100	25.607	0,20
OCP Euro CLO DAC				
4,091 % fällig am 22.09.2034		22.300	23.696	0,19
Palmer Square European Loan Funding DAC				
3,897 % fällig am 15.10.2031		11.915	12.740	0,10
3,907 % fällig am 15.07.2031		3.501	3.730	0,03
3,957 % fällig am 15.04.2031		16.011	17.161	0,14
Sculptor European CLO DAC				
3,916 % fällig am 14.01.2032		35.800	38.368	0,30
Segovia European CLO DAC				
4,080 % fällig am 20.07.2032		13.700	14.563	0,12
Tikehau CLO DAC				
4,144 % fällig am 04.08.2034		10.600	11.300	0,09
Toro European CLO DAC				
3,995 % fällig am 12.01.2032		9.300	9.952	0,08
4,133 % fällig am 15.02.2034		22.750	24.156	0,19
			637.782	5,06
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
AerCap Ireland Capital DAC				
1,650 % fällig am 29.10.2024	$	5.450	5.124	0,04
1,750 % fällig am 29.10.2024		5.300	4.980	0,04
2,450 % fällig am 29.10.2026		200	179	0,00
3,000 % fällig am 29.10.2028		900	779	0,01
3,500 % fällig am 15.01.2025		1.300	1.245	0,01
5,772 % fällig am 29.09.2023		7.250	7.240	0,05
			19.547	0,15
NON-AGENCY-MBS				
Bruegel DAC				
4,183 % fällig am 22.05.2031	€	341	351	0,00
European Loan Conduit DAC				
4,358 % fällig am 17.02.2030		3.058	3.267	0,03
			3.618	0,03
Summe Irland			660.947	5,24
ISRAEL				
STAATSEMISSIONEN				
Israel Government International Bond				
1,000 % fällig am 31.03.2030	ILS	800	181	0,00
1,500 % fällig am 30.11.2023		102.800	27.353	0,22
2,000 % fällig am 31.03.2027		87.900	22.160	0,17
4,500 % fällig am 17.01.2033	$	11.300	11.140	0,09
Summe Israel			60.834	0,48
ITALIEN				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
AMCO - Asset Management Co. SpA				
0,750 % fällig am 20.04.2028	€	300	272	0,00
1,500 % fällig am 17.07.2023		13.775	15.018	0,12
4,625 % fällig am 06.02.2027		17.500	18.980	0,15
Banca Monte dei Paschi di Siena SpA				
0,875 % fällig am 08.10.2027		8.000	7.793	0,06
2,000 % fällig am 29.01.2024		26.600	28.640	0,23
2,625 % fällig am 28.04.2025		2.800	2.868	0,03
Nexi SpA				
1,625 % fällig am 30.04.2026		6.639	6.618	0,05
UniCredit SpA				
7,830 % fällig am 04.12.2023	$	26.210	26.367	0,21
			106.556	0,85
STAATSEMISSIONEN				
Cassa Depositi e Prestiti SpA				
5,750 % fällig am 05.05.2026		21.500	21.235	0,17
Italy Government International Bond				
6,000 % fällig am 04.08.2028	£	5.684	7.055	0,05
			28.290	0,22
Summe Italien			134.846	1,07
JAPAN				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc.				
1,412 % fällig am 17.07.2025	$	29.800	$ 27.298	0,22
2,193 % fällig am 25.02.2025		33.700	31.776	0,25
Mizuho Financial Group, Inc.				
1,241 % fällig am 10.07.2024		9.000	8.994	0,07
3,922 % fällig am 11.09.2024		11.000	10.949	0,09
6,540 % fällig am 11.09.2024		13.000	13.016	0,10
Nissan Motor Co. Ltd.				
3,522 % fällig am 17.09.2025		2.100	1.954	0,01
Nomura Holdings, Inc.				
2,329 % fällig am 22.01.2027		11.100	9.821	0,08
Sumitomo Mitsui Banking Corp.				
0,010 % fällig am 10.09.2025	€	43.700	43.597	0,35
0,409 % fällig am 07.11.2029		26.500	23.590	0,19
0,550 % fällig am 06.11.2023		35.700	38.522	0,30
2,440 % fällig am 18.06.2024	$	26.400	25.520	0,20
Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc.				
5,520 % fällig am 13.01.2028		35.700	35.870	0,28
6,125 % fällig am 19.07.2023		31.100	31.106	0,25
Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd.				
0,010 % fällig am 15.10.2027	€	34.800	32.250	0,26
			334.263	2,65
STAATSEMISSIONEN				
Development Bank of Japan, Inc.				
1,750 % fällig am 28.08.2024	$	13.400	12.815	0,10
1,875 % fällig am 02.10.2024		12.800	12.226	0,10
Japan Finance Organization for Municipalities				
0,625 % fällig am 02.09.2025		1.400	1.268	0,01
3,000 % fällig am 12.03.2024		13.100	12.856	0,10
Japan Government International Bond				
0,005 % fällig am 01.02.2024	¥	700.000	4.848	0,04
0,005 % fällig am 01.03.2024		15.550.000	107.704	0,85
0,005 % fällig am 01.04.2024		8.140.000	56.386	0,45
0,005 % fällig am 01.05.2024		5.580.000	38.654	0,31
0,005 % fällig am 01.10.2024		17.912.450	124.140	0,98
0,100 % fällig am 10.03.2028 (e)		14.532.141	105.974	0,84
0,200 % fällig am 20.06.2036		362.750	2.376	0,02
0,500 % fällig am 20.09.2046		8.768.000	53.243	0,42
0,500 % fällig am 20.03.2049		11.468.000	67.241	0,53
0,700 % fällig am 20.12.2048		7.461.650	46.185	0,37
0,700 % fällig am 20.06.2051		202.000	1.217	0,01
1,000 % fällig am 20.03.2052		70.000	454	0,00
1,300 % fällig am 20.06.2052		500.000	3.492	0,03
Tokyo Metropolitan Government				
0,750 % fällig am 16.07.2025	$	18.600	16.962	0,14
			668.041	5,30
Summe Japan			1.002.304	7,95
JERSEY, KANALINSELN				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
G City Europe Ltd.				
4,250 % fällig am 11.09.2025	€	10.000	9.546	0,07
LUXEMBURG				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Aroundtown S.A.				
0,000 % fällig am 16.07.2026 (c)		11.000	9.202	0,07
0,375 % fällig am 15.04.2027		1.700	1.335	0,01
5,375 % fällig am 21.03.2029	$	2.700	2.001	0,02
CBRE Global Investors Open-Ended Fund S.C.A. SICAV-SIF Pan European Core Fund				
0,900 % fällig am 12.10.2029	€	200	160	0,00
CPI Property Group S.A.				
1,625 % fällig am 23.04.2027		16.100	12.839	0,10
1,750 % fällig am 14.01.2030		17.000	11.257	0,09
2,750 % fällig am 12.05.2026		1.400	1.243	0,01
2,750 % fällig am 22.01.2028	£	1.000	852	0,01
Logicor Financing SARL				
0,625 % fällig am 17.11.2025	€	4.600	4.402	0,03
0,750 % fällig am 15.07.2024		10.900	11.337	0,09
2,250 % fällig am 13.05.2025		2.000	2.031	0,02

BESCHREIBUNG		PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
Sberbank of Russia Via SB Capital S.A.				
5,125 % fällig am 29.10.2022 ^	$	500	$ 30	0,00
			56.689	0,45
NON-AGENCY-MBS				
Miravet SARL				
4,265 % fällig am 26.05.2065	€	13.365	14.356	0,11
Summe Luxemburg			71.045	0,56
MALAYSIA				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Petronas Capital Ltd.				
2,480 % fällig am 28.01.2032	$	5.500	4.598	0,04
3,500 % fällig am 21.04.2030		8.600	7.942	0,06
4,550 % fällig am 21.04.2050		6.100	5.609	0,04
4,800 % fällig am 21.04.2060		5.000	4.713	0,04
			22.862	0,18
STAATSEMISSIONEN				
Malaysia Government International Bond				
2,632 % fällig am 15.04.2031	MYR	36.118	7.123	0,06
Malaysia Government Investment Issue				
3,465 % fällig am 15.10.2030		21.759	4.561	0,03
			11.684	0,09
Summe Malaysia			34.546	0,27
MEXIKO				
STAATSEMISSIONEN				
Mexico Government International Bond				
4,000 % fällig am 15.03.2115	€	800	647	0,01
5,000 % fällig am 27.04.2051 (i)	$	7.800	6.782	0,05
Summe Mexiko			7.429	0,06
MULTINATIONAL				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Preferred Term Securities Ltd.				
5,862 % fällig am 22.12.2036		8.973	8.344	0,07
5,952 % fällig am 22.03.2038		2.939	2.587	0,02
Summe multinational			10.931	0,09
NIEDERLANDE				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
ABN AMRO Bank NV				
1,125 % fällig am 12.01.2032	€	300	277	0,00
Cooperatieve Rabobank UA				
3,758 % fällig am 06.04.2033	$	2.300	2.000	0,02
CTP NV				
0,625 % fällig am 27.09.2026	€	10.500	9.263	0,07
0,875 % fällig am 20.01.2026		14.100	13.136	0,11
1,500 % fällig am 27.09.2031		6.500	4.949	0,04
ING Groep NV				
4,100 % fällig am 02.10.2023	$	2.600	2.588	0,02
6,533 % fällig am 02.10.2023		2.400	2.403	0,02
Sagax Euro MTN NL BV				
1,625 % fällig am 24.02.2026	€	11.900	11.630	0,09
			46.246	0,37
NON-AGENCY-MBS				
Domi BV				
4,376 % fällig am 15.06.2051		120	131	0,00
Dutch Property Finance BV				
3,872 % fällig am 28.04.2051		124	135	0,00
3,892 % fällig am 28.07.2054		228	249	0,00
3,892 % fällig am 28.07.2058		13.820	15.057	0,12
Eurosail BV				
4,677 % fällig am 17.10.2040		39	42	0,00
Jubilee Place BV				
4,007 % fällig am 17.07.2058		10.221	11.136	0,09
4,177 % fällig am 17.10.2057		5.612	6.122	0,05
			32.872	0,26
Summe Niederlande			79.118	0,63

BESCHREIBUNG		PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
NEUSEELAND				
STAATSEMISSIONEN				
Auckland Council				
1,000 % fällig am 19.01.2027	€	5.800	$ 5.792	0,04
New Zealand Government International Bond				
1,500 % fällig am 15.05.2031	NZD	22.600	11.062	0,09
2,000 % fällig am 20.09.2025		1.279	783	0,01
Summe Neuseeland			17.637	0,14
NORWEGEN				
STAATSEMISSIONEN				
Kommunalbanken A/S				
0,625 % fällig am 20.04.2026	€	600	603	0,00
1,900 % fällig am 19.01.2027	AUD	22.000	13.306	0,11
5,250 % fällig am 15.07.2024		3.300	2.205	0,02
Norway Government International Bond				
1,250 % fällig am 17.09.2031	NOK	1.900	147	0,00
1,750 % fällig am 13.03.2025		86.700	7.783	0,06
1,750 % fällig am 17.02.2027		1.100	95	0,00
2,000 % fällig am 26.04.2028		7.300	628	0,01
Summe Norwegen			24.767	0,20
PERU				
STAATSEMISSIONEN				
Peru Government International Bond				
2,780 % fällig am 01.12.2060	$	6.000	3.684	0,03
3,230 % fällig am 28.07.2121		4.200	2.553	0,02
5,940 % fällig am 12.02.2029	PEN	5.817	1.577	0,01
6,150 % fällig am 12.08.2032		40.948	10.829	0,09
Summe Peru			18.643	0,15
POLEN				
STAATSEMISSIONEN				
Poland Government International Bond				
3,875 % fällig am 14.02.2033	€	15.400	16.691	0,13
4,250 % fällig am 14.02.2043		3.400	3.649	0,03
4,875 % fällig am 04.10.2033	$	6.400	6.294	0,05
5,500 % fällig am 16.11.2027		2.700	2.774	0,02
5,500 % fällig am 04.04.2053		5.800	5.852	0,05
Summe Polen			35.260	0,28
PORTUGAL				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Banco Espirito Santo S.A.				
4,000 % fällig am 21.01.2019 ^	€	6.900	1.844	0,02
4,750 % fällig am 15.01.2018 ^		1.900	508	0,00
Summe Portugal			2.352	0,02
KATAR				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
QatarEnergy				
2,250 % fällig am 12.07.2031	$	8.000	6.720	0,05
3,300 % fällig am 12.07.2051		5.100	3.754	0,03
			10.474	0,08
KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG				
Qatar National Bank QPSC				
5,966 % fällig am 10.10.2023		4.600	4.600	0,04
Summe Katar			15.074	0,12
RUMÄNIEN				
STAATSEMISSIONEN				
Romania Government International Bond				
1,375 % fällig am 02.12.2029	€	6.560	5.564	0,04
1,750 % fällig am 13.07.2030		16.600	13.846	0,11
2,000 % fällig am 28.01.2032		1.000	803	0,01
2,000 % fällig am 14.04.2033		2.150	1.661	0,01
2,124 % fällig am 16.07.2031 (i)		2.600	2.157	0,02
2,125 % fällig am 07.03.2028		19.300	18.318	0,14
2,625 % fällig am 02.12.2040		7.400	4.929	0,04
2,750 % fällig am 14.04.2041		7.000	4.699	0,04
2,875 % fällig am 13.04.2042		17.300	11.632	0,09
5,000 % fällig am 27.09.2026		6.800	7.455	0,06
6,625 % fällig am 27.09.2029		8.500	9.653	0,08
Summe Rumänien			80.717	0,64

BESCHREIBUNG		PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
SAUDI-ARABIEN				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Saudi Arabian Oil Co.				
2,250 % fällig am 24.11.2030	$	12.600	$ 10.503	0,08
3,250 % fällig am 24.11.2050		6.500	4.523	0,04
3,500 % fällig am 24.11.2070		1.600	1.066	0,01
			16.092	0,13
STAATSEMISSIONEN				
Saudi Arabia Government International Bond				
3,250 % fällig am 22.10.2030		3.100	2.817	0,02
4,750 % fällig am 18.01.2028		32.400	32.163	0,25
4,875 % fällig am 18.07.2033		33.500	33.507	0,27
5,000 % fällig am 18.01.2053		2.700	2.505	0,02
			70.992	0,56
Summe Saudi-Arabien			87.084	0,69
SINGAPUR				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Pfizer Investment Enterprises Pte. Ltd.				
4,450 % fällig am 19.05.2028		1.500	1.475	0,01
5,340 % fällig am 19.05.2063		8.400	8.507	0,07
Summe Singapur			9.982	0,08
SLOWENIEN				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Nova Kreditna Banka Maribor d.d.				
1,875 % fällig am 27.01.2025	€	11.200	11.819	0,09
Nova Ljubljanska Banka d.d.				
3,400 % fällig am 05.02.2030		3.500	3.246	0,03
3,650 % fällig am 19.11.2029		8.300	7.697	0,06
Summe Slowenien			22.762	0,18
SÜDKOREA				
STAATSEMISSIONEN				
South Korea Government International Bond				
2,000 % fällig am 10.06.2031	KRW	30.643.570	20.626	0,16
2,125 % fällig am 10.06.2027		16.365.000	11.725	0,09
2,375 % fällig am 10.12.2027		14.900.000	10.714	0,08
2,375 % fällig am 10.12.2028		69.980.000	49.708	0,39
2,625 % fällig am 10.06.2028		32.730.000	23.667	0,19
3,250 % fällig am 10.06.2033		68.223.770	50.062	0,40
4,250 % fällig am 10.12.2032		166.494.540	132.046	1,05
5,500 % fällig am 10.03.2028		14.900.000	12.197	0,10
Summe Südkorea			310.745	2,46
SPANIEN				
FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE				
BBVA Consumer Auto				
0,270 % fällig am 20.07.2031	€	5.189	5.518	0,04
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Banco Santander S.A.				
1,849 % fällig am 25.03.2026	$	5.800	5.193	0,04
4,175 % fällig am 24.03.2028		2.000	1.874	0,02
CaixaBank S.A.				
1,750 % fällig am 24.10.2023	€	10.400	11.272	0,09
			18.339	0,15
NON-AGENCY-MBS				
Fondo de Titulizacion de Activos Santander Hipotecario				
3,325 % fällig am 18.01.2049		389	419	0,00
Fondo de Titulizacion de Activos UCI				
3,097 % fällig am 15.09.2041		761	809	0,01
			1.228	0,01
STAATSEMISSIONEN				
Autonomous Community of Catalonia				
4,220 % fällig am 26.04.2035		3.900	4.224	0,03
Autonomous Community of Madrid				
1,571 % fällig am 30.04.2029		1.300	1.279	0,01
Spain Government International Bond				
1,450 % fällig am 31.10.2071		7.375	3.905	0,03
1,900 % fällig am 31.10.2052		2.700	1.952	0,02

BESCHREIBUNG		PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
3,450 % fällig am 30.07.2066	€	53.300 $	53.029	0,42
5,250 % fällig am 06.04.2029	£	800	995	0,01
			65.384	0,52
Summe Spanien			90.469	0,72
SUPRANATIONAL				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Europäische Bank für Wiederaufbau und Entwicklung				
0,500 % fällig am 01.09.2023	AUD	5.400	3.571	0,03
0,500 % fällig am 21.12.2023		4.000	2.607	0,02
Europäische Investitionsbank				
0,500 % fällig am 10.08.2023		10.200	6.763	0,05
4,600 % fällig am 30.01.2037	CAD	1.050	822	0,01
Inter-American Development Bank				
2,500 % fällig am 14.04.2027	AUD	15.200	9.396	0,07
Summe Supranational			23.159	0,18
SCHWEDEN				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Molnlycke Holding AB				
1,875 % fällig am 28.02.2025	€	400	419	0,00
SCHWEIZ				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Credit Suisse AG				
0,250 % fällig am 05.01.2026		11.800	11.508	0,09
6,500 % fällig am 08.08.2023 (g)	$	30.906	30.793	0,25
UBS Group AG				
2,193 % fällig am 05.06.2026		400	367	0,00
2,875 % fällig am 02.04.2032	€	19.700	18.760	0,15
3,091 % fällig am 14.05.2032	$	27.800	22.499	0,18
3,869 % fällig am 12.01.2029		12.550	11.356	0,09
4,194 % fällig am 01.04.2031		1.600	1.425	0,01
4,488 % fällig am 12.05.2026		1.500	1.451	0,01
4,550 % fällig am 17.04.2026		400	385	0,00
6,373 % fällig am 15.07.2026		900	895	0,01
6,442 % fällig am 11.08.2028		30.600	30.738	0,24
6,537 % fällig am 12.08.2033		5.700	5.843	0,05
7,375 % fällig am 07.09.2033	£	6.900	9.195	0,07
7,750 % fällig am 01.03.2029	€	15.900	19.238	0,15
Summe Schweiz			164.453	1,30
VEREINIGTE ARABISCHE EMIRATE				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
MDGH GMTN RSC Ltd.				
5,500 % fällig am 28.04.2033	$	7.000	7.370	0,06
GROSSBRITANNIEN				
FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE				
PCL Funding PLC				
5,469 % fällig am 15.10.2025	£	400	509	0,00
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
AstraZeneca PLC				
5,995 % fällig am 17.08.2023	$	400	400	0,00
Barclays PLC				
3,125 % fällig am 17.01.2024	£	800	999	0,01
4,375 % fällig am 12.01.2026	$	2.200	2.114	0,02
6,467 % fällig am 26.06.2024	AUD	4.000	2.684	0,02
Haleon UK Capital PLC				
3,125 % fällig am 24.03.2025	$	16.600	15.868	0,13
HSBC Holdings PLC				
2,848 % fällig am 04.06.2031		9.900	8.220	0,06
2,999 % fällig am 10.03.2026		1.300	1.233	0,01
3,973 % fällig am 22.05.2030		21.700	19.506	0,15
4,041 % fällig am 13.03.2028		7.300	6.842	0,05
4,583 % fällig am 19.06.2029		19.600	18.464	0,15
4,755 % fällig am 09.06.2028		11.200	10.770	0,09
5,210 % fällig am 11.08.2028		19.400	18.986	0,15
John Lewis PLC				
6,125 % fällig am 21.01.2025	£	100	122	0,00
Lloyds Banking Group PLC				
4,650 % fällig am 24.03.2026	$	1	1	0,00
Nationwide Building Society				
2,972 % fällig am 16.02.2028		8.800	7.913	0,06
4,363 % fällig am 01.08.2024		11.200	11.178	0,09
NatWest Group PLC				
5,076 % fällig am 27.01.2030	$	19.200 $	18.333	0,15
NatWest Markets PLC				
1,000 % fällig am 28.05.2024	€	7.721	8.189	0,06
Santander UK Group Holdings PLC				
4,796 % fällig am 15.11.2024	$	20.100	19.949	0,16
6,534 % fällig am 10.01.2029		1.900	1.915	0,02
Santander UK PLC				
5,234 % fällig am 12.02.2027	£	16.900	21.517	0,17
Standard Chartered PLC				
0,991 % fällig am 12.01.2025	$	13.400	12.997	0,10
1,822 % fällig am 23.11.2025		28.100	26.287	0,21
2,608 % fällig am 12.01.2028		12.700	11.256	0,09
2,678 % fällig am 29.06.2032		600	471	0,00
TP ICAP Finance PLC				
2,625 % fällig am 18.11.2028	£	9.800	9.211	0,07
			255.425	2,02
NON-AGENCY-MBS				
Alba PLC				
3,686 % fällig am 15.12.2038	€	97	101	0,00
5,171 % fällig am 15.12.2038	£	4.450	5.414	0,04
Avon Finance PLC				
5,809 % fällig am 20.09.2048		20.123	25.577	0,20
Brass PLC				
5,430 % fällig am 16.11.2066		4.372	5.574	0,04
Business Mortgage Finance PLC				
5,822 % fällig am 15.02.2041		5	7	0,00
Canada Square Funding PLC				
5,682 % fällig am 17.06.2058		16.815	21.262	0,17
5,852 % fällig am 17.06.2058		252	318	0,00
6,152 % fällig am 17.12.2057		4.555	5.802	0,05
Eurohome UK Mortgages PLC				
5,137 % fällig am 15.06.2044		132	162	0,00
Eurosail PLC				
3,629 % fällig am 13.03.2045	€	10	10	0,00
3,709 % fällig am 13.03.2045		400	418	0,00
3,766 % fällig am 15.12.2044		148	159	0,00
5,140 % fällig am 13.03.2045	£	52	65	0,00
5,690 % fällig am 13.09.2045		866	1.089	0,01
5,940 % fällig am 13.06.2045		49	61	0,00
Great Hall Mortgages PLC				
3,677 % fällig am 18.03.2039	€	237	256	0,00
3,697 % fällig am 18.06.2038		144	156	0,00
5,262 % fällig am 18.03.2039	£	4.670	5.709	0,05
5,644 % fällig am 18.06.2039	$	46	46	0,00
Ludgate Funding PLC				
3,212 % fällig am 01.01.2061	€	451	470	0,00
Mansard Mortgages PLC				
5,651 % fällig am 15.12.2049	£	5.743	7.154	0,06
Newgate Funding PLC				
3,704 % fällig am 01.12.2050	€	424	438	0,00
3,827 % fällig am 01.12.2050		1.632	1.607	0,01
4,126 % fällig am 15.12.2050		655	689	0,01
4,776 % fällig am 15.12.2050		1.951	1.953	0,02
4,880 % fällig am 01.12.2050	£	502	609	0,01
5,026 % fällig am 15.12.2050	€	3.406	3.312	0,03
5,038 % fällig am 01.12.2050	£	604	727	0,01
5,078 % fällig am 01.12.2050		362	429	0,00
6,005 % fällig am 15.12.2050		2.449	2.987	0,02
6,255 % fällig am 15.12.2050		2.181	2.555	0,02
Paragon Mortgages PLC				
5,541 % fällig am 15.11.2038	$	23	22	0,00
5,752 % fällig am 15.05.2045	£	2.799	3.561	0,03
Polaris PLC				
5,631 % fällig am 23.12.2058		6.008	7.604	0,06
Residential Mortgage Securities PLC				
6,159 % fällig am 20.06.2070		16.213	20.678	0,16
Resloc UK PLC				
5,161 % fällig am 15.12.2043		53	65	0,00
5,221 % fällig am 15.12.2043		2.499	2.993	0,02
5,250 % fällig am 15.12.2043	$	132	124	0,00
Ripon Mortgages PLC				
5,491 % fällig am 28.08.2056	£	80.930	102.525	0,81
RMAC Securities PLC				
3,736 % fällig am 12.06.2044	€	848	875	0,01
5,134 % fällig am 12.06.2044	£	351	427	0,00
5,154 % fällig am 12.06.2044		240	292	0,00
Southern Pacific Financing PLC				
5,221 % fällig am 10.03.2044	£	542 $	679	0,01
Stratton Mortgage Funding PLC				
5,391 % fällig am 20.07.2060		41.687	53.004	0,42
5,765 % fällig am 12.03.2052		15.710	19.903	0,16
Towd Point Mortgage Funding PLC				
5,635 % fällig am 20.10.2051		12.486	15.897	0,13
5,841 % fällig am 20.07.2045		21.156	26.909	0,21
Trinity Square PLC				
5,316 % fällig am 15.07.2059		14.720	18.687	0,15
Twin Bridges PLC				
5,715 % fällig am 12.03.2055		10.461	13.252	0,11
Uropa Securities PLC				
4,729 % fällig am 10.10.2040		53	65	0,00
Warwick Finance Residential Mortgages PLC				
0,000 % fällig am 21.12.2049 (c)		1	5.914	0,05
5,865 % fällig am 21.12.2049		33.599	42.513	0,34
6,564 % fällig am 21.12.2049		7.280	9.168	0,07
7,064 % fällig am 21.12.2049		3.640	4.559	0,04
7,564 % fällig am 21.12.2049		2.080	2.597	0,02
8,064 % fällig am 21.12.2049		2.080	2.553	0,02
			449.982	3,57
STAATSEMISSIONEN				
United Kingdom Gilt				
0,625 % fällig am 22.10.2050		46.810	24.193	0,19
1,250 % fällig am 31.07.2051		31.025	19.572	0,16
1,500 % fällig am 31.07.2053		11.300	7.503	0,06
			51.268	0,41
Summe Großbritannien			757.184	6,00
USA				
FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE				
Accredited Mortgage Loan Trust				
5,410 % fällig am 25.09.2036	$	1.302	1.281	0,01
ACE Securities Corp. Home Equity Loan Trust				
5,270 % fällig am 25.10.2036		4	2	0,00
5,410 % fällig am 25.12.2036		6.042	3.317	0,03
5,450 % fällig am 25.07.2036		2.155	801	0,01
5,945 % fällig am 25.01.2035		710	649	0,01
6,050 % fällig am 25.12.2034		947	849	0,01
6,050 % fällig am 25.08.2035		4.150	3.988	0,03
Ameriquest Mortgage Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates				
5,900 % fällig am 25.01.2036		600	577	0,00
6,125 % fällig am 25.07.2035		800	745	0,01
6,200 % fällig am 25.11.2034		630	617	0,01
Amortizing Residential Collateral Trust				
5,850 % fällig am 25.10.2031		27	26	0,00
Amresco Residential Securities Corp. Mortgage Loan Trust				
6,090 % fällig am 25.06.2029		41	39	0,00
Argent Securities Trust				
5,450 % fällig am 25.07.2036		6.152	5.246	0,04
Asset-Backed Funding Certificates Trust				
5,850 % fällig am 25.06.2034		236	229	0,00
Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust				
5,765 % fällig am 25.02.2036		2.325	2.258	0,02
5,790 % fällig am 25.12.2034		4	4	0,00
5,810 % fällig am 25.10.2032		3	2	0,00
6,150 % fällig am 25.11.2042		18	18	0,00
6,155 % fällig am 25.06.2035		1.412	1.352	0,01
6,200 % fällig am 25.08.2037		2.140	1.796	0,01
Centex Home Equity Loan Trust				
5,610 % fällig am 25.07.2032		16	14	0,00
CIT Mortgage Loan Trust				
6,500 % fällig am 25.10.2037		1.275	1.273	0,01
Citigroup Mortgage Loan Trust				
5,210 % fällig am 25.07.2045		61	42	0,00
5,570 % fällig am 25.01.2037		442	431	0,00
5,764 % fällig am 25.01.2037 ^		128	59	0,00
7,250 % fällig am 25.05.2036		1.333	710	0,01
Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.				
5,540 % fällig am 25.06.2037		3.157	3.110	0,02
Countrywide Asset-Backed Certificates				
5,830 % fällig am 25.12.2036 ^		119	87	0,00

BESCHREIBUNG		PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
Countrywide Asset-Backed Certificates Trust				
5,290 % fällig am 25.06.2037	$	1.406	$ 1.298	0,01
5,290 % fällig am 25.07.2037		733	666	0,01
5,290 % fällig am 25.08.2037		981	968	0,01
5,350 % fällig am 25.09.2047 ^		2.196	2.036	0,02
5,370 % fällig am 25.08.2037		15.000	13.033	0,10
5,370 % fällig am 25.09.2037 ^		437	439	0,00
5,370 % fällig am 25.06.2047		12.504	11.881	0,09
5,470 % fällig am 25.05.2047 ^		7.599	5.070	0,04
5,670 % fällig am 25.12.2036 ^		5.670	5.313	0,04
5,670 % fällig am 25.09.2046		3.570	3.393	0,03
5,810 % fällig am 25.08.2035		1.847	1.786	0,01
5,840 % fällig am 25.05.2036		2.482	2.443	0,02
5,990 % fällig am 25.10.2047		2.645	2.513	0,02
6,125 % fällig am 25.01.2036		4.680	4.533	0,04
6,200 % fällig am 25.11.2034		63	62	0,00
Countrywide Asset-Backed Certificates Trust, Inc.				
5,870 % fällig am 25.07.2034		102	101	0,00
Countrywide Asset-Backed Certificates, Inc.				
5,270 % fällig am 25.02.2035		252	232	0,00
Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp.				
4,599 % fällig am 25.01.2032		12	12	0,00
Credit-Based Asset Servicing & Securitization Trust				
5,270 % fällig am 25.11.2036		31	15	0,00
CSAB Mortgage-Backed Trust				
6,672 % fällig am 25.06.2036 ^		206	63	0,00
Delta Funding Home Equity Loan Trust				
5,833 % fällig am 15.08.2030		9	9	0,00
Ellington Loan Acquisition Trust				
6,250 % fällig am 25.05.2037		309	296	0,00
EMC Mortgage Loan Trust				
5,890 % fällig am 25.05.2040		13	12	0,00
Encore Credit Receivables Trust				
6,050 % fällig am 25.01.2036		6.000	5.647	0,04
Fieldstone Mortgage Investment Trust				
5,378 % fällig am 25.11.2036		2.029	1.181	0,01
First Franklin Mortgage Loan Trust				
5,260 % fällig am 25.12.2037		2.568	2.409	0,02
5,870 % fällig am 25.10.2035		16	16	0,00
Fremont Home Loan Trust				
5,285 % fällig am 25.10.2036		2.227	1.961	0,02
5,290 % fällig am 25.01.2037		2.385	1.212	0,01
6,215 % fällig am 25.06.2035		5.290	5.012	0,04
GSAA Home Equity Trust				
5,610 % fällig am 25.04.2047		311	152	0,00
5,630 % fällig am 25.06.2036		2.835	889	0,01
5,750 % fällig am 25.03.2037		289	122	0,00
5,750 % fällig am 25.05.2047		112	75	0,00
GSAMP Trust				
5,280 % fällig am 25.12.2046		8.060	4.387	0,03
5,290 % fällig am 25.12.2036		5.903	3.194	0,03
5,380 % fällig am 25.12.2046		7.062	3.557	0,03
5,430 % fällig am 25.06.2036		134	129	0,00
5,650 % fällig am 25.05.2046		475	446	0,00
5,825 % fällig am 25.11.2035		2.587	2.452	0,02
Home Equity Asset Trust				
5,710 % fällig am 25.08.2036		353	343	0,00
6,070 % fällig am 25.02.2033		2	2	0,00
Home Equity Mortgage Loan Asset-Backed Trust				
5,310 % fällig am 25.11.2036		6.366	5.419	0,04
5,470 % fällig am 25.04.2037		3.183	2.708	0,02
Home Equity Mortgage Trust				
6,000 % fällig am 25.01.2037 ^		484	442	0,00
HSI Asset Securitization Corp. Trust				
5,690 % fällig am 25.02.2036		2.202	2.158	0,02
Humboldt Americas LLC				
0,000 % fällig am 31.07.2022	COP	20.000.000	4.722	0,04
JPMorgan Mortgage Acquisition Trust				
5,370 % fällig am 25.08.2036	$	2.777	1.981	0,02
5,410 % fällig am 25.08.2036		443	438	0,00
5,420 % fällig am 25.08.2036		8.000	7.123	0,06
5,630 % fällig am 25.04.2036		5.267	4.958	0,04
Lehman ABS Mortgage Loan Trust				
5,240 % fällig am 25.06.2037		89	58	0,00
Long Beach Mortgage Loan Trust				
5,450 % fällig am 25.05.2036		3.759	2.187	0,02
5,710 % fällig am 25.10.2034		538	500	0,00
6,425 % fällig am 25.02.2035		7.161	6.909	0,05

BESCHREIBUNG		PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
MASTR Asset-Backed Securities Trust				
5,350 % fällig am 25.08.2036	$	16.340	$ 5.974	0,05
MASTR Specialized Loan Trust				
6,800 % fällig am 25.06.2043		198	200	0,00
Merrill Lynch Mortgage Investors Trust				
5,310 % fällig am 25.09.2037		12	3	0,00
5,870 % fällig am 25.05.2036		206	203	0,00
Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust				
5,210 % fällig am 25.05.2037		226	196	0,00
5,280 % fällig am 25.01.2037		2.649	1.215	0,01
5,290 % fällig am 25.10.2036		3.052	1.328	0,01
5,380 % fällig am 25.10.2036		10.237	5.423	0,04
5,400 % fällig am 25.07.2036		486	419	0,00
5,470 % fällig am 25.09.2036		4.342	1.943	0,02
5,650 % fällig am 25.04.2036		4.570	4.221	0,03
5,825 % fällig am 25.09.2035		500	464	0,00
7,050 % fällig am 25.02.2047		1.341	1.121	0,01
7,400 % fällig am 25.03.2033		49	46	0,00
Morgan Stanley Home Equity Loan Trust				
5,320 % fällig am 25.04.2037		3.637	1.908	0,02
5,380 % fällig am 25.04.2037		11.119	5.839	0,05
Morgan Stanley IXIS Real Estate Capital Trust				
5,200 % fällig am 25.11.2036		2	1	0,00
Morgan Stanley Mortgage Loan Trust				
5,610 % fällig am 25.02.2037		177	42	0,00
5,750 % fällig am 25.04.2037 ^		105	52	0,00
5,870 % fällig am 25.04.2037		296	87	0,00
6,000 % fällig am 25.02.2037 ^		135	78	0,00
New Century Home Equity Loan Trust				
3,720 % fällig am 20.06.2031		171	151	0,00
Nomura Home Equity Loan, Inc. Home Equity Loan Trust				
5,780 % fällig am 25.02.2036		4.100	3.640	0,03
Nomura Resecuritization Trust				
3,581 % fällig am 26.12.2037		991	842	0,01
NovaStar Mortgage Funding Trust				
5,490 % fällig am 25.01.2037		1.376	482	0,00
5,690 % fällig am 25.05.2036		3.600	3.368	0,03
5,810 % fällig am 25.01.2036		150	148	0,00
Option One Mortgage Loan Trust				
5,290 % fällig am 25.01.2037		732	477	0,00
5,290 % fällig am 25.03.2037		2.786	2.133	0,02
5,330 % fällig am 25.04.2037		14.542	7.290	0,06
5,370 % fällig am 25.04.2037		3.870	2.760	0,02
5,370 % fällig am 25.05.2037		4.826	2.847	0,02
5,830 % fällig am 25.11.2034		49	46	0,00
5,885 % fällig am 25.08.2035		26	26	0,00
6,020 % fällig am 25.05.2035		4.867	3.966	0,03
Ownit Mortgage Loan Trust				
5,438 % fällig am 25.05.2037		1.590	1.208	0,01
Park Place Securities, Inc.				
5,885 % fällig am 25.09.2035		183	178	0,00
People's Choice Home Loan Securities Trust				
6,500 % fällig am 25.01.2035		122	115	0,00
Renaissance Home Equity Loan Trust				
5,340 % fällig am 25.01.2037		15.587	5.479	0,04
5,850 % fällig am 25.08.2032		1	1	0,00
5,879 % fällig am 25.06.2037 ^		19.229	5.777	0,05
5,893 % fällig am 25.06.2037 ^		9.958	2.999	0,02
Residential Asset Mortgage Products Trust				
5,590 % fällig am 25.12.2036		576	557	0,00
5,830 % fällig am 25.12.2035		3.636	3.154	0,03
Residential Asset Securities Corp. Trust				
5,855 % fällig am 25.11.2035		600	573	0,00
Saxon Asset Securities Trust				
5,350 % fällig am 25.05.2047		8.125	7.042	0,06
5,460 % fällig am 25.09.2037		2.159	2.038	0,02
Securitized Asset-Backed Receivables LLC Trust				
5,250 % fällig am 25.12.2036		6	3	0,00
5,270 % fällig am 25.12.2036 ^		82	19	0,00
5,280 % fällig am 25.05.2037 ^		149	112	0,00
5,870 % fällig am 25.10.2035		523	419	0,00
5,975 % fällig am 25.10.2035		2.208	1.975	0,02
SG Mortgage Securities Trust				
5,470 % fällig am 25.07.2036		3.133	674	0,01
SLM Student Loan Trust				
3,661 % fällig am 25.10.2039	€	160	163	0,00
4,076 % fällig am 15.12.2033		900	906	0,01

BESCHREIBUNG		PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖG ENS
Soundview Home Loan Trust				
5,300 % fällig am 25.03.2037	$	609	$ 567	0,00
5,320 % fällig am 25.07.2037		1.867	1.533	0,01
5,320 % fällig am 25.08.2037		247	209	0,00
5,330 % fällig am 25.07.2037		156	133	0,00
5,350 % fällig am 25.06.2037		6.431	4.395	0,04
5,360 % fällig am 25.06.2037		12.404	8.353	0,07
5,555 % fällig am 25.12.2036		6.330	6.151	0,05
5,650 % fällig am 25.10.2036		8.866	8.279	0,07
5,650 % fällig am 25.11.2036		5.415	5.027	0,04
5,900 % fällig am 25.03.2036		955	931	0,01
6,050 % fällig am 25.10.2037		5.198	4.103	0,03
Specialty Underwriting & Residential Finance Trust				
4,460 % fällig am 25.12.2036		258	242	0,00
Structured Asset Investment Loan Trust				
5,770 % fällig am 25.01.2036		2.922	2.691	0,02
6,425 % fällig am 25.11.2034		1.953	1.894	0,02
Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust				
5,285 % fällig am 25.07.2036		181	179	0,00
6,670 % fällig am 25.04.2035		6	6	0,00
Terwin Mortgage Trust				
0,106 % fällig am 25.08.2037 ^		211	58	0,00
6,090 % fällig am 25.11.2033		5	4	0,00
Texas Natural Gas Securitization Finance Corp.				
5,169 % fällig am 01.04.2041		11.000	11.342	0,09
WaMu Asset-Backed Certificates WaMu Trust				
5,300 % fällig am 25.01.2037		2.667	2.198	0,02
Washington Mutual Asset-Backed Certificates Trust				
3,911 % fällig am 25.10.2036		49	18	0,00
Wells Fargo Home Equity Asset-Backed Securities Trust				
5,495 % fällig am 25.01.2037		5.276	5.054	0,04
			314.183	2,49
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
7-Eleven, Inc.				
0,800 % fällig am 10.02.2024		12.300	11.924	0,10
AbbVie, Inc.				
1,500 % fällig am 15.11.2023	€	1.200	1.298	0,01
Ally Financial, Inc.				
8,000 % fällig am 01.11.2031	$	300	312	0,00
American Tower Corp.				
2,950 % fällig am 15.01.2025		14.600	13.971	0,11
3,800 % fällig am 15.08.2029		7.400	6.760	0,05
Aviation Capital Group LLC				
4,125 % fällig am 01.08.2025		23.600	22.057	0,18
Bank of America Corp.				
1,949 % fällig am 27.10.2026	€	17.600	18.070	0,14
3,384 % fällig am 02.04.2026	$	11.800	11.317	0,09
4,412 % fällig am 24.08.2025	€	15.400	16.867	0,13
4,587 % fällig am 22.09.2026		6.200	6.750	0,05
5,202 % fällig am 25.04.2029	$	27.100	26.821	0,21
Bayer U.S. Finance LLC				
4,250 % fällig am 15.12.2025		5.700	5.502	0,04
6,562 % fällig am 15.12.2023		10.200	10.190	0,08
British Airways Pass-Through Trust				
3,300 % fällig am 15.06.2034		5.444	4.733	0,04
Broadcom, Inc.				
2,450 % fällig am 15.02.2031		8.300	6.754	0,05
Charter Communications Operating LLC				
3,750 % fällig am 15.02.2028		10.900	9.998	0,08
3,850 % fällig am 01.04.2061		5.100	3.089	0,02
4,500 % fällig am 01.02.2024		3.800	3.767	0,03
5,125 % fällig am 01.07.2049		600	473	0,00
6,384 % fällig am 23.10.2035		6.000	5.852	0,05
6,949 % fällig am 01.02.2024		7.700	7.733	0,06
Citigroup, Inc.				
3,290 % fällig am 17.03.2026 (h)		33.100	31.674	0,25
Corebridge Financial, Inc.				
3,500 % fällig am 04.04.2025		7.500	7.150	0,06
Credit Suisse AG AT1 Claim ^		1.200	48	0,00
Dell International LLC				
6,020 % fällig am 15.06.2026		2.700	2.746	0,02
Doctors Co. An Interinsurance Exchange				
4,500 % fällig am 18.01.2032		3.900	3.097	0,03
Energy Transfer LP				
4,500 % fällig am 15.04.2024		1.300	1.285	0,01

BESCHREIBUNG		PAR (000S)		MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
Ford Motor Credit Co. LLC					
2,748 % fällig am 14.06.2024	£	2.600	$	3.164	0,03
2,900 % fällig am 16.02.2028	$	700		600	0,01
3,370 % fällig am 17.11.2023		14.500		14.364	0,11
3,375 % fällig am 13.11.2025		2.700		2.513	0,02
3,664 % fällig am 08.09.2024		1.100		1.064	0,01
3,815 % fällig am 02.11.2027		1.400		1.253	0,01
4,389 % fällig am 08.01.2026		1.000		947	0,01
4,687 % fällig am 09.06.2025		600		578	0,01
5,584 % fällig am 18.03.2024		2.400		2.385	0,02
GA Global Funding Trust					
2,250 % fällig am 06.01.2027		9.400		8.335	0,07
GLP Capital LP					
5,250 % fällig am 01.06.2025		1.500		1.471	0,01
5,300 % fällig am 15.01.2029		2.500		2.383	0,02
Goldman Sachs Group, Inc.					
3,750 % fällig am 30.04.2024	€	18.600		20.302	0,16
4,281 % fällig am 07.02.2025		6.800		7.450	0,06
5,749 % fällig am 24.01.2025	$	19.000		18.973	0,15
Goodman U.S. Finance Three LLC					
3,700 % fällig am 15.03.2028		6.600		5.990	0,05
HCA, Inc.					
5,375 % fällig am 01.09.2026		2.170		2.154	0,02
Hyatt Hotels Corp.					
1,300 % fällig am 01.10.2023		100		99	0,00
JPMorgan Chase & Co.					
2,595 % fällig am 24.02.2026		21.600		20.492	0,16
4,080 % fällig am 26.04.2026		33.800		32.860	0,26
Komatsu Finance America, Inc.					
0,849 % fällig am 09.09.2023		500		495	0,00
Lehman Brothers Holdings, Inc.					
0,000 % fällig am 25.05.2010 ^		8.800		20	0,00
5,625 % fällig am 24.01.2013 ^		12.700		29	0,00
6,200 % fällig am 26.09.2014 ^		9.800		22	0,00
7,875 % fällig am 08.05.2018 ^	£	14.000		89	0,00
Morgan Stanley					
2,103 % fällig am 08.05.2026	€	30.000		31.250	0,25
2,630 % fällig am 18.02.2026	$	11.600		11.003	0,09
Organon & Co.					
2,875 % fällig am 30.04.2028	€	3.400		3.229	0,03
4,125 % fällig am 30.04.2028	$	4.900		4.354	0,03
Pacific Gas & Electric Co.					
2,100 % fällig am 01.08.2027		500		427	0,00
2,950 % fällig am 01.03.2026 ^		1.900		1.741	0,01
3,150 % fällig am 01.01.2026		5.300		4.921	0,04
3,300 % fällig am 01.12.2027 ^		800		702	0,01
3,400 % fällig am 15.08.2024 ^		1.300		1.258	0,01
3,450 % fällig am 01.07.2025		400		378	0,00
3,750 % fällig am 01.07.2028		1.500		1.345	0,01
4,000 % fällig am 01.12.2046 ^		1.600		1.075	0,01
4,250 % fällig am 15.03.2046 ^		800		570	0,00
4,300 % fällig am 15.03.2045 ^		1.500		1.073	0,01
4,500 % fällig am 01.07.2040		800		623	0,01
4,600 % fällig am 15.06.2043 ^		1.000		758	0,01
4,750 % fällig am 15.02.2044 ^		200		155	0,00
4,950 % fällig am 01.07.2050		600		472	0,00
Penske Truck Leasing Co. LP					
3,450 % fällig am 01.07.2024		4.800		4.677	0,04
Principal Life Global Funding					
1,375 % fällig am 10.01.2025		7.200		6.719	0,05
Sabine Pass Liquefaction LLC					
5,750 % fällig am 15.05.2024		6.500		6.491	0,05
Southern California Edison Co.					
1,100 % fällig am 01.04.2024		5.700		5.504	0,04
5,922 % fällig am 01.04.2024		2.900		2.896	0,02
Southern Co. Gas Capital Corp.					
2,450 % fällig am 01.10.2023		1.747		1.732	0,01
T-Mobile USA, Inc.					
5,050 % fällig am 15.07.2033		10.900		10.707	0,09
Warner Media LLC					
1,950 % fällig am 15.09.2023	€	350		380	0,00
Wells Fargo & Co.					
3,908 % fällig am 25.04.2026	$	8.700		8.416	0,07
				501.126	3,97

KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG

BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
CenturyLink, Inc.			
7,467 % fällig am 15.03.2027	9.143	7.080	0,05
Organon & Co.			
8,250 % fällig am 02.06.2028	$ 5.933	$ 5.939	0,05
		13.019	0,10

KOMMUNALANLEIHEN UND WECHSEL

BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
American Municipal Power, Inc., Ohio Revenue Bonds, (BABs), Series 2010			
6,270 % fällig am 15.02.2050	90	99	0,00
American Municipal Power, Inc., Ohio Revenue Bonds, Series 2010			
7,734 % fällig am 15.02.2033	100	118	0,00
7,834 % fällig am 15.02.2041	1.700	2.147	0,02
Golden State, California Tobacco Securitization Corp. Revenue Bonds, Series 2021			
3,850 % fällig am 01.06.2050	3.610	3.278	0,03
Golden State, California Tobacco Securitization Corp. Revenue Notes, (ST APPROP Insured), Series 2021			
2,346 % fällig am 01.06.2030	200	168	0,00
Golden State, California Tobacco Securitization Corp. Revenue Notes, Series 2021			
2,687 % fällig am 01.06.2030	6.000	5.042	0,04
2,787 % fällig am 01.06.2031	4.400	3.638	0,03
3,037 % fällig am 01.06.2032	8.045	6.640	0,05
Los Angeles County, California Public Works Financing Authority Revenue Bonds, (BABs), Series 2010			
7,618 % fällig am 01.08.2040	2.800	3.524	0,03
Louisiana Local Government Environmental Facilities & Community Development Auth Revenue Bonds, Series 2023			
5,048 % fällig am 01.12.2034	6.600	6.656	0,05
Municipal Electric Authority of Georgia Revenue Bonds, (BABs), Series 2010			
6,655 % fällig am 01.04.2057	286	328	0,00
New Jersey Transportation Trust Fund Authority Revenue Bonds, (BABs), Series 2010			
5,754 % fällig am 15.12.2028	200	202	0,00
		31.840	0,25

NON-AGENCY-MBS

BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
Adjustable Rate Mortgage Trust			
4,395 % fällig am 25.09.2035 ^	50	43	0,00
6,300 % fällig am 25.03.2035	571	479	0,00
American Home Mortgage Assets Trust			
4,896 % fällig am 25.11.2046	7.434	2.294	0,02
5,340 % fällig am 25.05.2046 ^	247	207	0,00
5,360 % fällig am 25.10.2046	65	36	0,00
5,530 % fällig am 25.09.2046 ^	736	628	0,01
American Home Mortgage Investment Trust			
7,129 % fällig am 25.09.2035	3.519	1.575	0,01
Banc of America Funding Trust			
3,896 % fällig am 20.10.2046 ^	99	84	0,00
4,245 % fällig am 20.11.2035 ^	90	80	0,00
4,416 % fällig am 20.01.2047 ^	103	96	0,00
4,449 % fällig am 20.02.2036	248	233	0,00
5,477 % fällig am 20.02.2047	612	532	0,01
5,750 % fällig am 25.11.2035	7	6	0,00
Banc of America Mortgage Trust			
4,330 % fällig am 25.09.2035	5	4	0,00
4,617 % fällig am 25.09.2033	6	6	0,00
BCAP LLC Trust			
4,175 % fällig am 26.01.2047	251	240	0,00
5,250 % fällig am 26.04.2037	550	320	0,00
5,490 % fällig am 25.01.2037 ^	24	22	0,00
5,590 % fällig am 25.05.2047 ^	165	158	0,00
Bear Stearns Adjustable Rate Mortgage Trust			
3,887 % fällig am 25.05.2047 ^	95	85	0,00
4,096 % fällig am 25.05.2034	70	59	0,00
4,342 % fällig am 25.08.2033	5	5	0,00
4,403 % fällig am 25.10.2033	27	25	0,00
4,439 % fällig am 25.02.2034	8	7	0,00
4,614 % fällig am 25.02.2036 ^	38	34	0,00
4,996 % fällig am 25.05.2034	65	59	0,00
5,500 % fällig am 25.08.2033	39	36	0,00
6,800 % fällig am 25.02.2036	49	46	0,00
Bear Stearns ALT-A Trust			
3,731 % fällig am 25.11.2036 ^	470	223	0,00
3,817 % fällig am 25.11.2036 ^	2.600	1.375	0,01
3,990 % fällig am 25.11.2035 ^	501	391	0,00
4,009 % fällig am 25.03.2036	$ 220	$ 132	0,00
4,116 % fällig am 25.08.2036 ^	1.198	626	0,01
4,164 % fällig am 25.08.2036 ^	10	7	0,00
4,195 % fällig am 25.05.2035	42	39	0,00
4,202 % fällig am 25.09.2035 ^	1.606	999	0,01
4,523 % fällig am 25.01.2036	1.100	1.013	0,01
5,470 % fällig am 25.02.2034	111	99	0,00
5,870 % fällig am 25.08.2035	9.644	8.990	0,07
Bear Stearns Mortgage Funding Trust			
5,310 % fällig am 25.12.2046	356	292	0,00
Bear Stearns Structured Products, Inc. Trust			
3,484 % fällig am 26.12.2046 ^	1.544	1.165	0,01
Chase Mortgage Finance Trust			
3,962 % fällig am 25.03.2037 ^	48	45	0,00
4,086 % fällig am 25.03.2037 ^	521	485	0,00
4,483 % fällig am 25.02.2037	128	125	0,00
4,529 % fällig am 25.07.2037	39	30	0,00
Citicorp Mortgage Securities Trust			
6,000 % fällig am 25.04.2037 ^	61	49	0,00
Citigroup Mortgage Loan Trust			
4,418 % fällig am 25.08.2035	67	66	0,00
5,278 % fällig am 25.08.2036	9.463	3.900	0,03
5,410 % fällig am 25.10.2035	8	8	0,00
6,980 % fällig am 25.05.2035	5	5	0,00
Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.			
5,014 % fällig am 25.08.2035 ^	237	220	0,00
6,080 % fällig am 25.09.2035	11	11	0,00
6,780 % fällig am 25.09.2035	111	110	0,00
Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc. Mortgage Pass-Through Certificates			
3,626 % fällig am 25.09.2035 ^	475	412	0,00
CitiMortgage Alternative Loan Trust			
5,750 % fällig am 25.02.2037	1.579	1.319	0,01
6,000 % fällig am 25.01.2037 ^	302	269	0,00
Commercial Mortgage Trust			
3,545 % fällig am 10.02.2036	28.500	25.903	0,21
3,590 % fällig am 10.11.2047	15.500	14.909	0,12
Countrywide Alternative Loan Trust			
3,369 % fällig am 25.10.2035 ^	9	8	0,00
4,048 % fällig am 20.11.2035	28	26	0,00
5,250 % fällig am 25.06.2035 ^	167	129	0,00
5,337 % fällig am 20.02.2047 ^	4.876	3.804	0,03
5,352 % fällig am 20.12.2046 ^	2.379	1.994	0,02
5,360 % fällig am 25.05.2035	31	28	0,00
5,367 % fällig am 20.07.2046 ^	242	195	0,00
5,390 % fällig am 25.06.2036	936	847	0,01
5,437 % fällig am 20.09.2046	1.219	879	0,01
5,470 % fällig am 25.02.2047	127	115	0,00
5,476 % fällig am 25.11.2035	305	261	0,00
5,490 % fällig am 25.05.2047	3.242	2.793	0,02
5,500 % fällig am 25.09.2035 ^	832	620	0,01
5,500 % fällig am 25.11.2035	1.484	1.019	0,01
5,500 % fällig am 25.05.2037 ^	530	172	0,00
5,550 % fällig am 25.05.2036	70	60	0,00
5,570 % fällig am 25.07.2046 ^	54	45	0,00
5,577 % fällig am 20.03.2046	1.585	1.299	0,01
5,610 % fällig am 25.11.2036 ^	5.535	4.804	0,04
5,617 % fällig am 20.05.2046 ^	2.455	2.089	0,02
5,710 % fällig am 25.02.2037	876	726	0,01
5,790 % fällig am 25.11.2035	11	9	0,00
5,797 % fällig am 20.12.2035	1.604	1.498	0,01
5,803 % fällig am 20.11.2035	357	330	0,00
5,830 % fällig am 25.10.2046 ^	772	568	0,01
5,900 % fällig am 25.07.2036	275	121	0,00
6,000 % fällig am 25.03.2036	1.822	843	0,01
6,000 % fällig am 25.02.2037 ^	177	81	0,00
6,016 % fällig am 25.11.2035	236	207	0,00
6,170 % fällig am 25.03.2037 ^	188	107	0,00
6,250 % fällig am 25.11.2036 ^	124	96	0,00
6,250 % fällig am 25.08.2037 ^	465	246	0,00
6,500 % fällig am 25.08.2032	3	3	0,00
6,690 % fällig am 25.11.2035	266	216	0,00
Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust			
3,514 % fällig am 25.04.2035	128	102	0,00
3,680 % fällig am 20.09.2036 ^	53	46	0,00
3,797 % fällig am 20.04.2036	980	855	0,01
3,810 % fällig am 25.11.2034	138	126	0,00
3,911 % fällig am 20.02.2036 ^	13	10	0,00
3,991 % fällig am 25.09.2033 ^	11	8	0,00
4,366 % fällig am 19.01.2034	34	30	0,00
5,500 % fällig am 25.11.2035 ^	63	32	0,00

BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
5,610 % fällig am 25.05.2035	$ 399	$ 338	0,00
5,730 % fällig am 25.04.2035	185	171	0,00
5,730 % fällig am 25.04.2035	11	9	0,00
5,750 % fällig am 25.07.2037 ^	323	169	0,00
5,790 % fällig am 25.03.2035	1.083	943	0,01
5,810 % fällig am 25.02.2035	222	203	0,00
5,830 % fällig am 25.02.2035	90	77	0,00
5,850 % fällig am 25.02.2036 ^	7	3	0,00
5,910 % fällig am 25.09.2034	23	22	0,00
5,910 % fällig am 20.02.2036 ^	12	10	0,00
5,910 % fällig am 20.02.2036 ^	21	18	0,00
6,000 % fällig am 25.07.2036	293	159	0,00
6,000 % fällig am 25.05.2037	1.063	511	0,01
6,500 % fällig am 25.12.2037	672	295	0,00
6,500 % fällig am 25.11.2047	508	275	0,00
Countrywide Home Loan Reperforming REMIC Trust			
5,510 % fällig am 25.03.2035 ^	617	551	0,01
6,000 % fällig am 25.03.2035 ^	44	41	0,00
Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp.			
5,449 % fällig am 25.03.2032	37	34	0,00
6,500 % fällig am 25.04.2033	3	3	0,00
Credit Suisse First Boston Mortgage-Backed Pass-Through Certificates			
4,260 % fällig am 25.07.2033	6	5	0,00
Credit Suisse Mortgage Capital Mortgage-Backed Trust			
6,079 % fällig am 25.04.2037 ^	66	18	0,00
Credit Suisse Mortgage Capital Trust			
3,474 % fällig am 25.06.2050	4.582	3.845	0,03
3,850 % fällig am 25.09.2057	9.181	8.614	0,07
DBGS Mortgage Trust			
6,038 % fällig am 15.06.2033	1.120	1.043	0,01
Deutsche ALT-A Securities Mortgage Loan Trust			
5,390 % fällig am 25.08.2036 ^	1.575	1.425	0,01
5,450 % fällig am 25.03.2037 ^	1.708	1.611	0,01
5,450 % fällig am 25.09.2047 ^	2.706	2.304	0,02
5,480 % fällig am 25.08.2037 ^	2.715	2.303	0,02
5,530 % fällig am 25.08.2047	3.467	2.839	0,02
Deutsche ALT-A Securities, Inc. Mortgage Loan Trust			
2,907 % fällig am 25.10.2035	8	8	0,00
Deutsche ALT-B Securities Mortgage Loan Trust			
5,250 % fällig am 25.10.2036 ^	6	5	0,00
Downey Savings & Loan Association Mortgage Loan Trust			
5,347 % fällig am 19.10.2036	1.238	1.027	0,01
5,997 % fällig am 19.09.2044	30	27	0,00
First Horizon Alternative Mortgage Securities Trust			
5,024 % fällig am 25.04.2035	77	75	0,00
6,250 % fällig am 25.11.2036 ^	157	53	0,00
6,250 % fällig am 25.08.2037 ^	167	73	0,00
First Horizon Mortgage Pass-Through Trust			
4,715 % fällig am 25.08.2035	51	37	0,00
GreenPoint Mortgage Funding Trust			
5,510 % fällig am 25.01.2037	629	546	0,01
5,570 % fällig am 25.04.2036	287	246	0,00
5,590 % fällig am 25.06.2045	50	47	0,00
5,690 % fällig am 25.04.2036 ^	188	179	0,00
5,690 % fällig am 25.11.2045	67	59	0,00
5,790 % fällig am 25.09.2046 ^	1.019	832	0,01
5,830 % fällig am 25.10.2046 ^	1.279	934	0,01
GreenPoint Mortgage Funding Trust Pass-Through Certificates			
4,725 % fällig am 25.10.2033	6	6	0,00
GS Mortgage Securities Corp. Trust			
6,343 % fällig am 15.07.2031	5.000	4.405	0,04
GSMSC Pass-Through Trust			
7,500 % fällig am 25.10.2036	51	10	0,00
GSR Mortgage Loan Trust			
3,935 % fällig am 25.01.2036 ^	38	37	0,00
4,070 % fällig am 25.09.2035	36	34	0,00
4,234 % fällig am 25.06.2034	20	19	0,00
4,481 % fällig am 25.11.2035	14	14	0,00
5,380 % fällig am 25.05.2037	9.822	5.038	0,04
5,500 % fällig am 25.01.2037	115	142	0,00
6,000 % fällig am 25.03.2032	0	0	0,00
6,780 % fällig am 25.03.2033	20	19	0,00
6,970 % fällig am 25.04.2032	76	63	0,00
HarborView Mortgage Loan Trust			
4,201 % fällig am 19.07.2035 ^	51	37	0,00
4,688 % fällig am 19.08.2036 ^	41	38	0,00
4,826 % fällig am 19.12.2036 ^	$ 290	$ 247	0,00
5,347 % fällig am 19.09.2037	495	434	0,00
5,546 % fällig am 19.09.2046 ^	566	523	0,01
5,567 % fällig am 19.12.2036	8.609	7.194	0,06
5,626 % fällig am 19.03.2036 ^	117	107	0,00
5,657 % fällig am 19.01.2036	319	198	0,00
5,857 % fällig am 19.01.2035	89	79	0,00
5,976 % fällig am 19.10.2035	379	213	0,00
6,657 % fällig am 19.10.2035	229	153	0,00
HomeBanc Mortgage Trust			
5,510 % fällig am 25.12.2036	1	1	0,00
HSI Asset Loan Obligation Trust			
6,000 % fällig am 25.06.2037 ^	34	30	0,00
Impac CMB Trust			
5,790 % fällig am 25.03.2035	6	6	0,00
6,150 % fällig am 25.07.2033	4	4	0,00
Impac Secured Assets Trust			
5,670 % fällig am 25.01.2037	3.991	3.195	0,03
IndyMac Mortgage Loan Trust			
3,093 % fällig am 25.01.2036 ^	41	38	0,00
3,281 % fällig am 25.10.2035	98	78	0,00
3,327 % fällig am 25.03.2036	474	325	0,00
3,367 % fällig am 25.06.2036	155	124	0,00
3,438 % fällig am 25.03.2036 ^	1.864	1.320	0,01
3,482 % fällig am 25.08.2035 ^	90	69	0,00
3,916 % fällig am 25.12.2034	48	46	0,00
5,510 % fällig am 25.02.2037 ^	1.489	1.325	0,01
5,550 % fällig am 25.06.2046	899	720	0,01
5,630 % fällig am 25.06.2037	111	100	0,00
JPMBB Commercial Mortgage Securities Trust			
0,719 % fällig am 15.04.2047 (a)	21.560	64	0,00
JPMorgan Alternative Loan Trust			
4,667 % fällig am 25.12.2035 ^	683	509	0,01
5,500 % fällig am 25.11.2036 ^	12	6	0,00
5,630 % fällig am 25.10.2036	2.861	2.555	0,02
5,660 % fällig am 27.06.2037	140	101	0,00
JPMorgan Mortgage Trust			
3,854 % fällig am 25.11.2033	56	51	0,00
3,963 % fällig am 25.12.2034	177	165	0,00
4,000 % fällig am 25.02.2036 ^	133	99	0,00
4,018 % fällig am 25.08.2034	82	80	0,00
4,047 % fällig am 25.07.2035	84	81	0,00
4,121 % fällig am 25.02.2036 ^	403	315	0,00
4,282 % fällig am 25.06.2036 ^	210	156	0,00
4,319 % fällig am 25.07.2035	36	34	0,00
Lehman XS Trust			
5,510 % fällig am 25.12.2036	2.509	2.434	0,02
5,610 % fällig am 25.05.2046	228	389	0,00
Luminent Mortgage Trust			
5,510 % fällig am 25.12.2036 ^	208	190	0,00
5,550 % fällig am 25.10.2046	361	322	0,00
MASTR Adjustable Rate Mortgages Trust			
4,560 % fällig am 21.11.2034	81	77	0,00
MASTR Alternative Loan Trust			
5,550 % fällig am 25.03.2036 ^	677	68	0,00
MASTR Asset Securitization Trust			
6,000 % fällig am 25.06.2036 ^	152	101	0,00
Mellon Residential Funding Corp. Mortgage Pass-Through Certificates			
5,893 % fällig am 15.11.2031	47	45	0,00
Mellon Residential Funding Corp. Mortgage Pass-Through Trust			
5,632 % fällig am 20.10.2029	17	17	0,00
5,633 % fällig am 15.12.2030	43	41	0,00
Merrill Lynch Alternative Note Asset Trust			
5,470 % fällig am 25.01.2037	8.769	2.748	0,02
Merrill Lynch Mortgage Investors Trust			
4,015 % fällig am 25.12.2034	136	128	0,00
4,229 % fällig am 25.06.2037	15	14	0,00
4,386 % fällig am 25.02.2033	65	61	0,00
5,810 % fällig am 25.06.2028	12	11	0,00
Merrill Lynch Mortgage-Backed Securities Trust			
3,673 % fällig am 25.04.2037 ^	724	646	0,01
Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust			
3,732 % fällig am 15.05.2048	8.100	7.693	0,06
Morgan Stanley Mortgage Loan Trust			
3,103 % fällig am 25.11.2037	479	318	0,00
3,647 % fällig am 25.11.2035 ^	24	18	0,00
5,410 % fällig am 25.04.2035	151	141	0,00
MortgageIT Securities Corp. Mortgage Loan Trust			
5,610 % fällig am 25.06.2047	$ 3.983	$ 3.239	0,03
New Century Alternative Mortgage Loan Trust			
6,173 % fällig am 25.07.2036	4.907	1.177	0,01
New Residential Mortgage Loan Trust			
3,500 % fällig am 25.12.2057	2.177	2.042	0,02
Nomura Asset Acceptance Corp. Alternative Loan Trust			
3,834 % fällig am 25.10.2035	29	17	0,00
NovaStar Mortgage Funding Trust			
0,440 % fällig am 25.09.2046	1.323	463	0,00
Residential Accredit Loans, Inc. Trust			
3,923 % fällig am 25.08.2035 ^	39	15	0,00
4,165 % fällig am 25.06.2046	4.580	1.116	0,01
5,091 % fällig am 25.11.2037	1.664	1.388	0,01
5,300 % fällig am 25.02.2047	405	153	0,00
5,450 % fällig am 25.06.2037 ^	1.056	939	0,01
5,470 % fällig am 25.03.2047	1.510	1.360	0,01
5,570 % fällig am 25.04.2046	3.480	1.028	0,01
5,650 % fällig am 25.08.2037	492	449	0,00
6,000 % fällig am 25.06.2036	365	291	0,00
Residential Asset Securitization Trust			
5,550 % fällig am 25.01.2046 ^	11	3	0,00
5,750 % fällig am 25.02.2036	1.791	1.381	0,01
5,750 % fällig am 25.04.2037 ^	1.129	596	0,01
6,000 % fällig am 25.07.2037 ^	773	335	0,00
6,500 % fällig am 25.08.2036 ^	1.089	328	0,00
Residential Funding Mortgage Securities, Inc. Trust			
4,149 % fällig am 25.09.2035 ^	223	144	0,00
6,500 % fällig am 25.03.2032	7	7	0,00
Sequoia Mortgage Trust			
3,271 % fällig am 20.01.2047 ^	262	173	0,00
3,723 % fällig am 20.07.2037	624	504	0,01
4,601 % fällig am 20.04.2035	29	28	0,00
5,846 % fällig am 19.10.2026	21	20	0,00
5,857 % fällig am 20.07.2033	121	110	0,00
5,917 % fällig am 20.10.2027	2	2	0,00
Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust			
3,525 % fällig am 25.11.2035 ^	44	39	0,00
4,045 % fällig am 25.07.2035 ^	758	651	0,01
4,222 % fällig am 25.08.2035	92	80	0,00
4,974 % fällig am 25.12.2035	388	286	0,00
4,984 % fällig am 25.09.2034	169	161	0,00
5,227 % fällig am 25.09.2034	4	4	0,00
5,282 % fällig am 25.02.2034	47	44	0,00
5,470 % fällig am 25.10.2035	354	324	0,00
5,590 % fällig am 25.05.2037	9	8	0,00
5,701 % fällig am 25.04.2034	47	45	0,00
Structured Asset Mortgage Investments Trust			
3,547 % fällig am 25.05.2047 ^	2.399	1.975	0,02
5,270 % fällig am 25.08.2036	1.520	1.319	0,01
5,330 % fällig am 25.01.2037	1.970	1.750	0,02
5,330 % fällig am 25.09.2047	1.512	1.386	0,01
5,370 % fällig am 25.09.2047	22	19	0,00
5,376 % fällig am 25.12.2035 ^	71	58	0,00
5,470 % fällig am 25.01.2037	1.116	985	0,01
5,476 % fällig am 25.08.2047 ^	1.183	1.065	0,01
5,530 % fällig am 25.06.2036	42	40	0,00
5,550 % fällig am 25.10.2036	2.397	2.092	0,02
5,570 % fällig am 25.05.2036	444	299	0,00
5,570 % fällig am 25.09.2047 ^	2.133	1.767	0,02
5,590 % fällig am 25.05.2036	2.298	1.843	0,02
5,590 % fällig am 25.05.2046	2.467	858	0,01
5,646 % fällig am 19.07.2035	28	27	0,00
5,670 % fällig am 25.05.2046 ^	47	28	0,00
5,710 % fällig am 25.02.2036 ^	293	247	0,00
5,726 % fällig am 19.07.2034	22	20	0,00
5,806 % fällig am 19.09.2032	18	17	0,00
5,846 % fällig am 19.03.2034	4	4	0,00
Structured Asset Securities Corp.			
5,430 % fällig am 25.01.2036	69	55	0,00
Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust			
5,440 % fällig am 25.10.2036	514	431	0,00
TBW Mortgage-Backed Trust			
6,130 % fällig am 25.01.2037 ^	27	7	0,00
Thornburg Mortgage Securities Trust			
3,018 % fällig am 25.09.2037	18	17	0,00
6,400 % fällig am 25.06.2037 ^	558	512	0,01
7,101 % fällig am 25.06.2037	1.267	1.059	0,01
7,151 % fällig am 25.06.2037	1.486	1.267	0,01
7,151 % fällig am 25.06.2047 ^	990	869	0,01

BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
7,151 % fällig am 25.06.2047	$ 4	$ 4	0,00
7,201 % fällig am 25.03.2037 ^	648	537	0,01
Towd Point Mortgage Trust			
3,750 % fällig am 25.05.2058	9.249	8.731	0,07
Verus Securitization Trust			
1,829 % fällig am 25.10.2066	6.439	5.483	0,04
WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust			
3,320 % fällig am 25.05.2037 ^	910	715	0,01
3,528 % fällig am 25.12.2036 ^	449	395	0,00
3,626 % fällig am 25.09.2036	232	201	0,00
3,645 % fällig am 25.03.2036 ^	1.035	934	0,01
3,754 % fällig am 25.09.2036 ^	2.685	2.303	0,02
3,823 % fällig am 27.02.2034	65	61	0,00
3,852 % fällig am 25.08.2035	26	23	0,00
3,875 % fällig am 25.12.2035	239	218	0,00
3,883 % fällig am 25.03.2036	48	44	0,00
3,974 % fällig am 25.05.2037 ^	1.439	1.274	0,01
4,008 % fällig am 25.12.2046	19	17	0,00
4,016 % fällig am 25.03.2033	7	6	0,00
4,134 % fällig am 25.08.2034	60	58	0,00
4,154 % fällig am 25.09.2033	5	5	0,00
4,163 % fällig am 25.09.2033	10	9	0,00
4,280 % fällig am 25.03.2034	4	4	0,00
4,830 % fällig am 25.06.2033	34	33	0,00
4,856 % fällig am 25.10.2046 ^	2.244	1.927	0,02
4,956 % fällig am 25.06.2046	560	513	0,01
4,976 % fällig am 25.02.2046	1.426	1.273	0,01
4,976 % fällig am 25.08.2046	72	67	0,00
5,176 % fällig am 25.11.2042	23	21	0,00
5,226 % fällig am 25.01.2047	333	300	0,00
5,376 % fällig am 25.08.2042	0	0	0,00
5,476 % fällig am 25.10.2046	9	8	0,00
5,610 % fällig am 25.04.2045	15	15	0,00
5,690 % fällig am 25.12.2045	14	14	0,00
5,730 % fällig am 25.07.2045	236	220	0,00
5,730 % fällig am 25.10.2045	68	65	0,00
5,770 % fällig am 25.01.2045	137	134	0,00
5,790 % fällig am 25.01.2045	42	40	0,00
5,890 % fällig am 25.11.2034	163	149	0,00
5,970 % fällig am 25.11.2045	271	251	0,00
5,970 % fällig am 25.12.2045	3.285	2.993	0,02
Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates Trust			
4,916 % fällig am 25.07.2046 ^	447	279	0,00
5,500 % fällig am 25.04.2035	121	99	0,00
5,750 % fällig am 25.07.2036 ^	67	43	0,00
Washington Mutual MSC Mortgage Pass-Through Certificates Trust			
4,324 % fällig am 25.06.2033	3	3	0,00
Wells Fargo Alternative Loan Trust			
4,412 % fällig am 28.12.2037 ^	240	221	0,00
6,250 % fällig am 25.07.2037 ^	406	344	0,00
		245.119	1,95

US-REGIERUNGSBEHÖRDEN

BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
Fannie Mae			
3,000 % fällig am 01.03.2060	7.946	7.024	0,06
3,500 % fällig am 01.01.2059	23.406	21.360	0,17
3,621 % fällig am 01.12.2034	35	34	0,00
3,649 % fällig am 01.10.2034	15	15	0,00
3,835 % fällig am 01.08.2033	21	20	0,00
4,082 % fällig am 25.05.2035	1	1	0,00
4,295 % fällig am 01.08.2035	71	70	0,00
4,415 % fällig am 01.11.2034	257	262	0,00
4,560 % fällig am 01.08.2036	1	1	0,00
4,633 % fällig am 01.12.2030	1	1	0,00
4,943 % fällig am 01.06.2043	4	4	0,00
4,944 % fällig am 01.11.2042 - 01.10.2044	43	42	0,00
5,144 % fällig am 01.09.2040	11	11	0,00
5,248 % fällig am 01.06.2035	2	2	0,00
5,258 % fällig am 25.03.2034	31	31	0,00
5,288 % fällig am 25.08.2034	5	5	0,00
5,377 % fällig am 01.01.2033	22	21	0,00
5,500 % fällig am 25.09.2042 - 25.03.2044	40	39	0,00
5,524 % fällig am 25.12.2036	177	172	0,00
5,550 % fällig am 25.06.2029 - 25.06.2036	199	196	0,00
6,000 % fällig am 25.04.2043 - 25.07.2044	606	604	0,01
6,086 % fällig am 01.04.2033	$ 35	$ 35	0,00
6,295 % fällig am 01.04.2033	50	50	0,00
6,500 % fällig am 01.11.2036	76	76	0,00
7,000 % fällig am 25.07.2042	70	73	0,00
Freddie Mac			
3,000 % fällig am 01.11.2026 - 01.04.2045	359	328	0,00
3,500 % fällig am 01.08.2026 - 01.04.2049	5.212	4.821	0,04
3,885 % fällig am 01.10.2034	18	18	0,00
3,981 % fällig am 01.08.2035	19	18	0,00
4,000 % fällig am 01.09.2024 - 01.09.2041	3	3	0,00
4,021 % fällig am 01.09.2035	10	10	0,00
4,344 % fällig am 01.10.2033	18	18	0,00
4,442 % fällig am 01.09.2037	104	106	0,00
5,000 % fällig am 15.08.2035 - 01.12.2039	460	453	0,00
5,176 % fällig am 25.10.2044 - 25.02.2045	928	855	0,01
5,280 % fällig am 25.08.2031	0	0	0,00
5,290 % fällig am 25.09.2031	41	41	0,00
5,376 % fällig am 25.07.2044	21	19	0,00
5,500 % fällig am 01.06.2037 - 01.10.2039	43	45	0,00
5,643 % fällig am 15.12.2031	0	0	0,00
5,673 % fällig am 15.10.2040	1.640	1.600	0,01
5,693 % fällig am 15.06.2041	2.427	2.377	0,02
5,793 % fällig am 15.12.2037	60	60	0,00
6,000 % fällig am 15.04.2036	1.192	1.238	0,01
7,000 % fällig am 01.10.2037	7	7	0,00
Ginnie Mae			
2,625 % fällig am 20.09.2023 - 20.09.2026	3	3	0,00
2,750 % fällig am 20.11.2026	0	0	0,00
2,875 % fällig am 20.04.2027 - 20.05.2030	7	7	0,00
3,000 % fällig am 20.04.2030 - 20.05.2047	380	357	0,00
3,625 % fällig am 20.01.2025 - 20.01.2030	1	2	0,00
4,500 % fällig am 15.04.2039	23	22	0,00
4,628 % fällig am 20.01.2066	1.469	1.450	0,01
5,000 % fällig am 20.04.2038	12	12	0,00
5,500 % fällig am 20.08.2035 - 15.02.2039	163	162	0,00
5,924 % fällig am 20.08.2066	3.953	3.932	0,03
Small Business Administration			
4,760 % fällig am 01.09.2025	9	9	0,00
4,840 % fällig am 01.05.2025	5	5	0,00
5,090 % fällig am 01.10.2025	5	5	0,00
5,110 % fällig am 01.04.2025	1	1	0,00
5,490 % fällig am 01.05.2028	13	13	0,00
5,600 % fällig am 01.09.2028	5	5	0,00
5,680 % fällig am 01.06.2028	3	3	0,00
6,220 % fällig am 01.12.2028	37	37	0,00
Tennessee Valley Authority			
5,880 % fällig am 01.04.2036	500	568	0,01
Uniform Mortgage-Backed Security			
2,500 % fällig am 01.05.2030 - 01.01.2052	57.005	48.718	0,39
3,000 % fällig am 01.01.2027 - 01.06.2051	26.442	23.512	0,19
3,500 % fällig am 01.11.2034 - 01.07.2050	32.648	30.308	0,24
4,000 % fällig am 01.01.2026 - 01.10.2052	21.596	20.474	0,16
4,500 % fällig am 01.08.2023 - 01.09.2052	9.441	9.106	0,07
5,500 % fällig am 01.08.2023 - 01.11.2039	34	35	0,00
6,500 % fällig am 01.06.2036 - 01.06.2037	12	12	0,00
Uniform Mortgage-Backed Security, TBA			
2,500 % fällig am 01.08.2053	238.050	202.194	1,60
3,500 % fällig am 01.08.2053	73.900	67.419	0,54
4,000 % fällig am 01.07.2053	605.558	568.822	4,51
4,500 % fällig am 01.07.2053	641.400	616.996	4,89
5,000 % fällig am 01.07.2053	546.500	535.607	4,25
5,500 % fällig am 01.07.2053	726.800	723.224	5,74
6,000 % fällig am 01.08.2053	866.950	874.468	6,93
6,500 % fällig am 01.07.2053	840.600	858.204	6,81
		4.627.858	36,70

US-SCHATZOBLIGATIONEN

BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
U.S. Treasury Bonds			
1,375 % fällig am 15.11.2040	$ 61.050	$ 40.894	0,32
1,625 % fällig am 15.11.2050	117.170	72.831	0,58
1,875 % fällig am 15.02.2041	205.300	149.252	1,18
1,875 % fällig am 15.02.2051	100	66	0,00
2,000 % fällig am 15.08.2051	7.100	4.842	0,04
2,875 % fällig am 15.05.2052	26.900	22.305	0,18
3,250 % fällig am 15.05.2042	200	179	0,00
4,000 % fällig am 15.11.2052	38.080	39.127	0,31
U.S. Treasury Inflation Protected Securities (e)			
0,125 % fällig am 15.04.2025	91.886	87.424	0,69
0,125 % fällig am 15.07.2031	35.987	31.928	0,25
0,125 % fällig am 15.01.2032	9.301	8.192	0,07
0,250 % fällig am 15.01.2025	100.142	96.011	0,76
0,375 % fällig am 15.01.2027	43.947	41.246	0,33
0,375 % fällig am 15.07.2027	161	151	0,00
0,500 % fällig am 15.01.2028	88.074	82.408	0,65
0,625 % fällig am 15.07.2032	5.533	5.088	0,04
0,750 % fällig am 15.07.2028	9.304	8.820	0,07
1,125 % fällig am 15.01.2033	93.577	89.715	0,71
1,750 % fällig am 15.01.2028	25.626	25.337	0,20
2,375 % fällig am 15.01.2027	1.504	1.512	0,01
2,500 % fällig am 15.01.2029	56.933	58.654	0,47
3,875 % fällig am 15.04.2029	36.532	40.375	0,32
U.S. Treasury Notes			
0,375 % fällig am 30.09.2027	2.400	2.043	0,02
0,750 % fällig am 31.01.2028	100	86	0,00
2,500 % fällig am 31.03.2027	4.600	4.312	0,03
2,875 % fällig am 30.04.2025	96.500	92.943	0,74
3,500 % fällig am 15.02.2033	25.500	24.842	0,20
		1.030.583	8,17
Summe USA		6.763.728	53,63

KURZFRISTIGE INSTRUMENTE

COMMERCIAL PAPER

BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
AT+T, Inc.			
5,700 % fällig am 19.03.2024	48.150	46.094	0,37
Electricite de France S.A.			
5,510 % fällig am 03.08.2023	25.400	25.266	0,20
Enel Finance America LLC			
5,450 % fällig am 24.07.2023	5.300	5.281	0,04
		76.641	0,61

HUNGARY TREASURY BILLS

BESCHREIBUNG		PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
16,220 % fällig am 06.07.2023 (c)(d)	HUF	11.026.000	32.185	0,25

BESCHREIBUNG		PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
ISRAEL TREASURY BILLS				
1,716 % fällig am 05.07.2023 (c)(d)	ILS	18.700	$ 5.036	0,04
JAPAN TREASURY BILLS				
(0,211) % fällig am 24.07.2023 (c)(d)	¥	10.929.000	75.620	0,60
(0,206) % fällig am 18.07.2023 (c)(d)		22.054.000	152.594	1,21
(0,202) % fällig am 28.08.2023 (c)(d)		9.595.000	66.398	0,53
(0,200) % fällig am 14.08.2023 (c)(d)		19.909.000	137.765	1,09
(0,200) % fällig am 28.08.2023 (c)(d)		17.494.000	121.060	0,96
(0,199) % fällig am 11.09.2023 (c)(d)		3.981.000	27.550	0,22
(0,189) % fällig am 28.08.2023 (c)(d)		9.075.000	62.800	0,50
(0,188) % fällig am 18.07.2023 (c)(d)		29.186.000	201.941	1,60
(0,188) % fällig am 28.08.2023 (c)(d)		26.396.000	182.663	1,45
(0,187) % fällig am 10.07.2023 (c)(d)		20.140.000	139.347	1,10
(0,187) % fällig am 21.08.2023 (c)(d)		22.611.000	156.466	1,24
(0,184) % fällig am 04.09.2023 (c)(d)		46.240.000	319.993	2,54
(0,183) % fällig am 21.08.2023 (c)(d)		39.310.000	272.022	2,16
(0,182) % fällig am 24.07.2023 (c)(d)		5.801.000	40.139	0,32
(0,179) % fällig am 11.09.2023 (c)(d)		889.000	6.152	0,05
(0,176) % fällig am 14.08.2023 (c)(d)	¥	7.111.000	$ 49.206	0,39
(0,168) % fällig am 10.07.2023 (c)(d)		8.190.000	56.666	0,45
(0,163) % fällig am 21.08.2023 (c)(d)		42.739.000	295.751	2,34
(0,152) % fällig am 25.09.2023 (c)(d)		13.957.000	96.593	0,76
(0,132) % fällig am 25.09.2023 (c)(d)		22.423.000	155.185	1,23
			2.615.911	20,74
Summe kurzfristige Instrumente			2.729.773	21,64
Summe Übertragbare Wertpapiere			**$ 14.608.940**	**115,83**
INVESTMENTFONDS				
ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN				
PIMCO Funds: Global Investors Series plc - Global Bond Ex-US Fund (f)		AKTIEN 10.956.929	108.693	0,86
PIMCO Funds: Global Investors Series plc - PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund (f)		4.437.728	47.217	0,37
PIMCO Funds: Global Investors Series plc - PIMCO European High Yield Bond Fund (f)		1.355.380	15.349	0,12
PIMCO Funds: Global Investors Series plc - UK Corporate Bond Fund (f)		7.715.431	$ 82.690	0,65
PIMCO Funds: Global Investors Series plc - US Short-Term Fund (f)		336.429	3.378	0,03
PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (f)		17.941.969	178.665	1,42
PIMCO Specialty Funds Ireland p.l.c. - PIMCO China Bond Fund (f)		345.274	4.500	0,04
			440.492	3,49
BÖRSENGEHANDELTE FONDS				
PIMCO ETFs plc - PIMCO Euro Short Maturity UCITS ETF (f)		3.455.880	365.620	2,90
PIMCO ETFs plc - PIMCO US Dollar Short Maturity UCITS ETF (f)		4.464.740	443.483	3,52
			809.103	6,42
Summe Investmentfonds			**$ 1.249.595**	**9,91**

PENSIONSGESCHÄFTE

Kontrahent	Kredit-zins	Abrechnungs-datum	Fälligkeits-datum	Kapital-betrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensions-geschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensions-geschäft[1]	% des Nettovermögens
BPS	5,110 %	30.06.2023	03.07.2023	$ 127.200	U.S. Treasury Notes 2,625 % fällig am 15.04.2025	$ (129.709)	$ 127.200	$ 127.254	1,01
BRC	5,120	30.06.2023	03.07.2023	593.800	U.S. Treasury Notes 4,625 % fällig am 30.05.2025	(605.974)	593.800	594.053	4,71
	5,130	30.06.2023	03.07.2023	100	Ginnie Mae 2,500 % fällig am 20.08.2051	(102)	100	100	0,00
Summe Pensionsgeschäfte						**$ (735.785)**	**$ 721.100**	**$ 721.407**	**5,72**

[1] Umfasst aufgelaufene Zinsen.

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

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

FUTURES

Beschreibung	Art	Ablauf-monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
3-Month SOFR December Futures	Short	03.2024	2.638	$ 7.010	0,05
3-Month SOFR June Futures	Short	09.2024	1.273	452	0,00
3-Month SOFR March Futures	Long	06.2024	1.273	(288)	0,00
Australia Government 3-Year Note September Futures	Short	09.2023	1.037	401	0,00
Australia Government 10-Year Bond September Futures	Short	09.2023	1.351	642	0,01
Canada Government 10-Year Bond September Futures	Short	09.2023	4	6	0,00
Euro-Bobl September Futures	Short	09.2023	6.617	12.223	0,09
Euro-BTP Italy Government Bond September Futures	Short	09.2023	319	(349)	0,00
Euro-BTP Italy Government Bond September Futures	Short	09.2023	2.884	3.212	0,03
Euro-Bund 10-Year Bond September Futures	Short	09.2023	75	95	0,00
Euro-Buxl 30-Year Bond September Futures	Long	09.2023	17	38	0,00
Euro-OAT France Government 10-Year Bond September Futures	Short	09.2023	5.108	1.832	0,01
Euro-Schatz September Futures	Short	09.2023	9.056	2.119	0,02
Japan Government 10-Year Bond September Futures	Short	09.2023	76	(278)	0,00
U.S. Treasury 5-Year Note September Futures	Long	09.2023	50	(107)	0,00
U.S. Treasury 10-Year Note September Futures	Long	09.2023	2.194	(4.317)	(0,03)
U.S. Treasury 10-Year Ultra September Futures	Short	09.2023	643	818	0,01
U.S. Treasury 30-Year Bond September Futures	Long	09.2023	36	(2)	0,00
U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond September Futures	Short	09.2023	33	(65)	0,00
United Kingdom Long Gilt September Futures	Short	09.2023	1.501	446	0,00
				$ 23.888	0,19

VERKAUFSOPTIONEN

OPTIONEN AUF BÖRSENGEHANDELTE TERMINKONTRAKTE

Beschreibung	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Anzahl der Kontrakte	Aufgeld	Markt-wert	% des Nettovermögens
Put - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note August Futures	$ 111,500	21.07.2023	295	$ (129)	$ (111)	0,00
Call - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note August Futures	115,500	21.07.2023	295	(103)	(15)	0,00
Call - CME-Kaufoptionen mit Ausübungskurs bei 98,000 USD auf 3-Month SOFR December Futures	98,000	15.12.2023	222	0	(11)	0,00
Put - CME-Verkaufsoptionen mit Ausübungskurs bei 96,500 USD auf 3-Month SOFR December Futures	96,500	15.12.2023	222	0	(1.046)	(0,01)
				$ (232)	$ (1.183)	(0,01)
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate					**$ 22.705**	**0,18**

ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)

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

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMMISSIONEN - SCHUTZVERKAUF[1]

Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag[3]	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
AT&T, Inc.	1,000 %	20.12.2023	$ 5.900	$ (58)	0,00
Ford Motor Credit Co. LLC	5,000	20.06.2026	800	38	0,00
Jaguar Land Rover Automotive PLC	5,000	20.06.2026	€ 17.500	(947)	(0,01)
				$ (967)	(0,01)

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES - SCHUTZKAUF[2]

Index/Tranchen	Zu bezahlender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag[3]	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
CDX.IG-39 10-Year Index	(1,000) %	20.12.2032	$ 2.060	$ (11)	0,00
CDX.IG-40 10-Year Index	(1,000)	20.06.2033	801.370	(9.046)	(0,07)
				$ (9.057)	(0,07)

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF[1]

Index/Tranchen	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag[3]	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
CDX.IG-39 5-Year Index	1,000 %	20.12.2027	$ 103.500	$ 933	0,01
CDX.IG-40 5-Year Index	1,000	20.06.2028	1.112.600	8.065	0,06
iTraxx Europe Main 39 5-Year Index	1,000	20.06.2028	€ 53.000	139	0,00
				$ 9.137	0,07

ZINSSWAPS

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Zahlung[4]	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	3,250 %	20.09.2053	£ 27.400	$ (2.476)	(0,02)
Zahlung[4]	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	3,500	20.09.2033	787.110	(39.469)	(0,31)
Zahlung[4]	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	3,750	20.09.2028	64.200	(4.096)	(0,03)
Erhalt[4]	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	4,000	20.09.2025	119.200	4.386	0,03
Erhalt	1-Day INR-MIBOR Compounded-OIS	6,250	16.03.2032	INR 1.997.200	(1.051)	(0,01)
Zahlung	1-Day INR-MIBOR Compounded-OIS	6,500	15.03.2028	3.212.810	319	0,00
Zahlung	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,000	17.03.2031	¥ 14.710.000	(2.550)	(0,02)
Zahlung	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,050	15.12.2031	19.820.000	(180)	0,00
Zahlung	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,200	19.06.2029	6.440.000	(1.586)	(0,01)
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,400	19.06.2039	13.160.000	6.788	0,05
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,450	15.12.2051	770.000	(67)	0,00
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,800	15.06.2052	3.460.000	1.365	0,01
Zahlung	1-Day SGD-SIBCSORA Compounded-OIS	3,000	15.03.2028	SGD 47.830	(906)	(0,01)
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	0,000	15.07.2023	$ 578.050	7.814	0,06
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	0,000	25.08.2023	155.100	(2.152)	(0,02)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	0,000	31.08.2023	178.000	(2.474)	(0,02)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	0,400	15.01.2028	578.050	(91.394)	(0,72)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,000	15.06.2029	16.880	(813)	(0,01)
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,249	31.08.2024	178.000	8.660	0,07
Erhalt[4]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,250	15.12.2026	444.500	47.347	0,38
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,298	25.08.2024	155.100	7.544	0,06
Erhalt[4]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,360	17.09.2024	53.950	2.140	0,02
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,430	31.03.2024	256.050	(9.936)	(0,08)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,488	15.08.2031	25.600	(4.403)	(0,04)
Zahlung[4]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,500	15.12.2028	233.690	(30.907)	(0,25)
Zahlung[4]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,518	20.01.2029	17.800	(2.201)	(0,02)
Zahlung[4]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,545	20.01.2029	3.000	(367)	0,00

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits-datum		Nenn-betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Zahlung[4]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,630	20.01.2029	$	63.600	$ (7.515)	(0,06)
Zahlung[4]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,630	26.01.2029		14.700	(1.725)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,750	15.06.2024		610.261	7.769	0,06
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,750	15.06.2025		6.500	7	0,00
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,750	15.06.2027		632.731	16.152	0,13
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,750	15.06.2052		35.650	(1.146)	(0,01)
Zahlung[4]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,000	15.12.2051		66.000	(22.984)	(0,18)
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,750	21.06.2053		6.600	114	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,750	21.06.2053		74.840	(2.075)	(0,02)
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,965	30.11.2026		565.100	28.324	0,22
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,000	21.06.2033		71.300	1.468	0,01
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,000	21.06.2033		34.180	(381)	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,050	08.09.2029		11.300	(487)	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,100	09.09.2029		31.000	(1.242)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,100	15.11.2032		42.410	(1.558)	(0,01)
Erhalt[4]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,150	13.05.2025		1.265.400	12.333	0,10
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,163	30.09.2029		37.000	(1.390)	(0,01)
Zahlung[4]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,165	03.10.2053		16.700	52	0,00
Erhalt[4]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,200	13.05.2025		78.400	887	0,01
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,225	30.09.2029		5.200	(195)	0,00
Zahlung[4]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,240	03.10.2053		16.700	287	0,00
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,250	21.06.2028		27.300	619	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,250	21.06.2028		16.280	(294)	0,00
Zahlung[4]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,250	20.12.2053		59.700	214	0,00
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,300	31.05.2027		100.800	2.783	0,02
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,300	14.06.2033		34.000	(602)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,425	01.03.2033		12.510	(161)	0,00
Erhalt[4]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,445	03.10.2038		55.400	18	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,454	30.06.2029		82.000	(1.454)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,470	22.02.2030		15.800	(265)	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,500	22.06.2030		32.300	(288)	0,00
Erhalt[4]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,500	20.12.2030		2.800	27	0,00
Zahlung[4]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,500	20.12.2033		84.008	(617)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,525	02.03.2030		16.200	(224)	0,00
Erhalt[4]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,533	03.10.2038		55.400	(540)	0,00
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,750	21.06.2025		186.000	2.986	0,02
Erhalt[4]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,750	20.12.2028		244.593	2.111	0,02
Zahlung[4]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,752	03.10.2028		71.600	(112)	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,800	10.03.2028		10.300	(85)	0,00
Zahlung[4]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,850	03.10.2028		71.600	198	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,898	30.06.2029		66.300	381	0,00
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	4,159	31.03.2025		214.600	3.516	0,03
Erhalt[4]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	4,250	20.12.2025		838.819	4.418	0,03
Zahlung[4]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	4,409	04.10.2024		300.600	(3.778)	(0,03)
Erhalt[4]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	4,409	04.10.2024		300.600	3.927	0,03
Zahlung[4]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	4,427	27.09.2024		350.000	(4.183)	(0,03)
Erhalt[4]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	4,427	27.09.2024		350.000	3.566	0,03
Zahlung[4]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	4,433	06.09.2024		611.900	(7.399)	(0,06)
Erhalt[4]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	4,433	06.09.2024		611.900	6.391	0,05
Zahlung[4]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	4,789	07.03.2024		110.900	(891)	(0,01)
Erhalt[4]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	4,789	07.03.2024		110.900	489	0,00
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	1,235	04.03.2025	CAD	57.400	(3.369)	(0,03)
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	1,500	17.06.2025		89.200	(3.708)	(0,03)
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	1,500	17.06.2030		207.300	(21.113)	(0,17)
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	1,713	02.10.2029		81.100	(7.994)	(0,06)
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	1,900	18.12.2029		107.300	(10.663)	(0,08)
Erhalt	3-Month CAD-Bank Bill	2,500	28.01.2052		700	5	0,00
Erhalt	3-Month CAD-Bank Bill	3,250	15.03.2033		88.700	3.226	0,03
Zahlung	3-Month CAD-CAONREPO Compounded-OIS	3,250	21.06.2033		101.600	440	0,00
Erhalt	3-Month CAD-CAONREPO Compounded-OIS	3,250	21.06.2053		11.000	12	0,00
Zahlung[4]	3-Month CAD-CAONREPO Compounded-OIS	3,500	10.05.2025		1.745.300	(10.656)	(0,08)
Zahlung	3-Month CHF-SRFXON3 Compounded-OIS	0,283	14.02.2027	CHF	47.000	(3.167)	(0,03)
Zahlung	3-Month CHF-SRFXON3 Compounded-OIS	0,294	10.02.2027		19.900	(1.288)	(0,01)
Zahlung	3-Month CHF-SRFXON3 Compounded-OIS	0,343	16.05.2027		31.300	(2.059)	(0,02)
Zahlung	3-Month CNY-CNREPOFIX	2,500	16.03.2027	CNY	382.500	542	0,00
Erhalt	3-Month CNY-CNREPOFIX	2,500	21.12.2027		21.700	(36)	0,00
Zahlung	3-Month CNY-CNREPOFIX	2,500	21.12.2027		21.700	36	0,00
Zahlung	3-Month EUR-ESTRON Compounded-OIS	1,000	23.11.2024	€	259.600	(4.745)	(0,04)
Zahlung	3-Month KRW-KORIBOR	3,250	15.03.2028	KRW	693.114.366	(9.580)	(0,08)
Erhalt	3-Month KRW-KORIBOR	3,250	15.03.2033		38.398.724	87	0,00
Erhalt[4]	3-Month KRW-KORIBOR	3,250	20.09.2033		76.861.620	169	0,00
Zahlung	3-Month NZD-BBR	0,110	16.12.2023	NZD	600	(9)	0,00
Zahlung	3-Month NZD-BBR	0,528	17.03.2024		10.000	(227)	0,00
Zahlung	3-Month NZD-BBR	3,000	15.12.2023		354.250	(2.910)	(0,02)
Zahlung	3-Month NZD-BBR	3,750	15.06.2027		102.300	(1.616)	(0,01)
Zahlung	3-Month NZD-BBR	4,000	14.06.2024		624.400	(5.001)	(0,04)
Zahlung[4]	3-Month NZD-BBR	5,000	20.03.2025		324.700	(504)	0,00
Zahlung[4]	3-Month NZD-BBR	5,250	20.03.2025		15.800	(11)	0,00
Zahlung	3-Month SEK-STIBOR	0,500	19.06.2024	SEK	260.100	(1.463)	(0,01)
Zahlung	3-Month SEK-STIBOR	1,000	19.06.2029		56.700	(848)	(0,01)
Erhalt	3-Month THB-THORON Compounded-OIS	2,250	15.03.2028	THB	4.091.920	1.380	0,01

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits-datum		Nenn-betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	0,000	15.07.2023	$	578.050	$ (7.752)	(0,06)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	0,000	25.08.2023		155.100	2.145	0,02
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	0,000	31.08.2023		178.000	2.496	0,02
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,250	15.09.2023		444.500	4.916	0,04
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,360	17.09.2023		53.950	375	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,500	15.09.2023		233.690	(2.439)	(0,02)
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,518	20.07.2023		17.800	(103)	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,545	20.07.2023		3.000	(17)	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,630	20.07.2023		63.600	(331)	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,630	26.07.2023		14.700	(77)	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	2,000	15.09.2023		66.000	(606)	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	4,409	04.07.2023		300.600	645	0,01
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	4,409	04.07.2023		300.600	(650)	(0,01)
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	4,427	27.07.2023		350.000	(875)	(0,01)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	4,427	27.09.2023		350.000	1.083	0,01
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	4,433	06.07.2023		611.900	(267)	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	4,433	06.09.2023		611.900	1.813	0,01
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	4,789	07.07.2023		110.900	(14)	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	4,789	07.09.2023		110.900	234	0,00
Erhalt	6-Month AUD-BBR-BBSW	1,250	17.06.2030	AUD	128.300	18.826	0,15
Zahlung	6-Month AUD-BBR-BBSW	1,750	16.03.2027		92.600	(5.565)	(0,04)
Zahlung	6-Month AUD-BBR-BBSW	4,000	21.06.2033		123.700	(3.207)	(0,03)
Zahlung[4]	6-Month AUD-BBR-BBSW	4,250	15.09.2032		40.100	(173)	0,00
Zahlung	6-Month AUD-BBR-BBSW	4,250	15.03.2033		206.600	(4.326)	(0,03)
Zahlung[4]	6-Month AUD-BBR-BBSW	4,500	15.09.2032		663.500	909	0,01
Zahlung	6-Month CZK-PRIBOR	1,913	30.01.2029	CZK	158.300	(1.040)	(0,01)
Erhalt[4]	6-Month EUR-EURIBOR	0,054	27.05.2050	€	7.450	3.349	0,03
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	0,064	17.11.2052		17.650	9.673	0,08
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	0,550	10.08.2024		12.500	(559)	0,00
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	0,650	12.04.2027		34.400	(3.653)	(0,03)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	0,650	11.05.2027		24.400	(2.540)	(0,02)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	0,700	11.04.2027		19.200	(2.013)	(0,02)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	1,000	30.03.2024		76.900	(1.967)	(0,02)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	1,000	13.05.2027		41.000	(3.846)	(0,03)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	1,000	18.05.2027		18.100	(1.697)	(0,01)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,100	11.04.2024		103.300	(1.618)	(0,01)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,100	13.04.2024		218.700	(3.421)	(0,03)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,100	17.05.2024		55.200	(934)	(0,01)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,250	26.04.2024		32.200	(447)	0,00
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,250	28.04.2024		38.500	(573)	0,00
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,250	03.05.2024		32.900	(492)	0,00
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,250	21.09.2037		55.870	(2.153)	(0,02)
Erhalt[4]	6-Month EUR-EURIBOR	2,500	20.09.2053		371.000	(2.383)	(0,02)
Zahlung[4]	6-Month EUR-EURIBOR	3,000	19.03.2027		489.180	(3.510)	(0,03)
Zahlung[4]	6-Month EUR-EURIBOR	3,000	20.09.2028		1.385.700	(5.465)	(0,04)
Erhalt[4]	6-Month EUR-EURIBOR	3,000	15.03.2033		221.155	(595)	0,00
Zahlung[4]	6-Month EUR-EURIBOR	3,000	20.09.2033		1.691.300	5.269	0,04
Zahlung[4]	6-Month EUR-EURIBOR	3,500	20.09.2025		430.700	(4.186)	(0,03)
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	4,870	07.07.2025	MXN	393.200	(2.152)	(0,02)
						$ (178.202)	(1,41)
	Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate					**$ (179.089)**	**(1,42)**

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

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

(3) Der maximal mögliche Betrag, den der Fonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

(4) Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft.

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

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

OPTIONSKAUF

ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag[1]	Kosten	Markt-wert	% des Nettovermögens
BOA	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,180 %	11.01.2024	49.700	$ 1.420	$ 5.103	0,04

OPTIONEN AUF WERTPAPIERE

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag[1]	Kosten	Markt-wert	% des Nettovermögens
BPS	Put - OTC France Government International Bond 0,750 % fällig am 25.05.2052	€ 97,000	23.05.2025	26.800	$ 2.027	$ 11.170	0,09

VERKAUFSOPTIONEN

ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag[1]	Aufgeld	Markt-wert	% des Nettovermögens
BOA	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,150 %	01.12.2023	31.200	$ (97)	$ (3)	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,650	01.12.2023	31.200	(97)	(422)	(0,01)
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,310	11.01.2024	441.600	(1.425)	(10.683)	(0,09)
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,380	31.07.2023	17.200	(66)	(82)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,780	31.07.2023	17.200	(66)	(51)	0,00
	Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,070	10.07.2023	3.100	(20)	(8)	0,00
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,370	10.07.2023	3.100	(20)	(2)	0,00
BPS	Put - OTC 25-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	0,451	23.05.2025	26.800	(2.027)	(10.259)	(0,08)
	Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,000	03.07.2023	3.600	(25)	0	0,00
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,400	03.07.2023	3.600	(25)	0	0,00
BRC	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,260	26.07.2023	17.000	(55)	(34)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,660	26.07.2023	17.000	(55)	(82)	0,00
	Call - OTC 7-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,350	27.07.2023	5.900	(14)	(11)	0,00
	Put - OTC 7-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,850	27.07.2023	5.900	(14)	(21)	0,00
CBK	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,690	02.04.2024	33.700	(265)	(40)	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,690	02.04.2024	33.700	(265)	(620)	(0,01)
DUB	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,920	13.10.2023	19.700	(119)	(2)	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,920	13.10.2023	19.700	(119)	(423)	(0,01)
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,790	08.04.2024	39.000	(300)	(51)	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,790	08.04.2024	39.000	(300)	(678)	(0,01)
FAR	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,688	02.04.2024	14.400	(113)	(17)	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,688	02.04.2024	14.400	(113)	(265)	0,00
	Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,000	03.07.2023	6.800	(47)	0	0,00
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,400	03.07.2023	6.800	(47)	0	0,00
	Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,100	31.08.2023	29.300	(215)	(42)	0,00
	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,800	31.08.2023	29.300	(215)	(298)	0,00
GLM	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,920	13.10.2023	12.100	(74)	(1)	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,920	13.10.2023	12.100	(74)	(260)	0,00
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,018	20.10.2023	13.000	(84)	(2)	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,018	20.10.2023	13.000	(84)	(265)	0,00
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,140	23.10.2023	14.200	(100)	(2)	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,140	23.10.2023	14.200	(100)	(272)	0,00
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,190	23.10.2023	13.700	(95)	(2)	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,190	23.10.2023	13.700	(95)	(257)	0,00
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,225	23.10.2023	14.200	(98)	(2)	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,225	23.10.2023	14.200	(98)	(261)	0,00
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,973	25.10.2023	17.400	(120)	(2)	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,973	25.10.2023	17.400	(120)	(361)	0,00
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,841	27.10.2023	14.900	(102)	(2)	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,841	27.10.2023	14.900	(102)	(325)	0,00
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,088	03.11.2023	10.800	(78)	(2)	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,088	03.11.2023	10.800	(78)	(209)	0,00
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,910	10.11.2023	25.900	(172)	(5)	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,910	10.11.2023	25.900	(172)	(538)	(0,01)
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,250	17.11.2023	38.900	(141)	(4)	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,750	17.11.2023	38.900	(141)	(506)	(0,01)
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,150	20.11.2023	24.600	(86)	(2)	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,650	20.11.2023	24.600	(86)	(341)	0,00
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,250	07.12.2023	22.800	(71)	(3)	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,750	07.12.2023	22.800	(71)	(285)	0,00
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,697	02.04.2024	6.300	(49)	(7)	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,697	02.04.2024	6.300	(49)	(116)	0,00
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,721	08.04.2024	15.300	(116)	(19)	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,721	08.04.2024	15.300	(116)	(275)	0,00
	Call - OTC 7-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,350	27.07.2023	6.900	(16)	(13)	0,00
	Put - OTC 7-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,850	27.07.2023	6.900	(16)	(24)	0,00
JPM	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	6-Month GBP-LIBOR	Erhalt	0,820	16.12.2024	123.600	(873)	(129)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,250	20.07.2023	3.000	(10)	(4)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,650	20.07.2023	3.000	(10)	(12)	0,00
MYC	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,993	11.10.2023	9.500	(64)	(2)	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,993	11.10.2023	9.500	(64)	(200)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,270	24.07.2023	6.900	(23)	(12)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,670	24.07.2023	6.900	(23)	(28)	0,00
							$ (9.995)	$ (28.844)	(0,23)

[1] Der Nennbetrag stellt die Anzahl der Kontrakte dar.

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMMISSIONEN - SCHUTZVERKAUF[1]

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag[2]	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Markt-wert	% des Nettovermögens
BOA	Italy Government International Bond	1,000 %	20.06.2025	$ 11.810	$ (285)	$ 429	$ 144	0,00
BRC	Italy Government International Bond	1,000	20.06.2025	17.350	(421)	633	212	0,00
CBK	Italy Government International Bond	1,000	20.06.2025	4.020	(97)	146	49	0,00
					$ (803)	$ 1.208	$ 405	0,00

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

(2) Der maximal mögliche Betrag, den der Fonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

CROSS-CURRENCY SWAPS

Kontrahent	Erhalt	Zahlung	Fälligkeits-datum	Nennbetrag erhaltener Währung	Nennbetrag gelieferter Währung	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Markt-wert	% des Nettovermögens
AZD	Variabler Zinssatz entspricht 3-Month AUD-LIBOR zzgl. 0,290 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung	Variabler Zinssatz entspricht 3-Month USD-LIBOR basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung	04.01.2031	AUD 106.300	$ 80.086	$ 526	$ (309)	$ 217	0,00
CBK	Variabler Zinssatz entspricht 3-Month AUD-LIBOR zzgl. 0,420 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung	Variabler Zinssatz entspricht 3-Month USD-LIBOR basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung	31.07.2029	105.500	72.795	(26)	167	141	0,00
GLM	Variabler Zinssatz entspricht 3-Month AUD-LIBOR zzgl. 0,423 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung	Variabler Zinssatz entspricht 3-Month USD-LIBOR basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung	01.08.2029	101.200	69.828	(205)	168	(37)	0,00
MYC	Variabler Zinssatz entspricht 3-Month AUD-LIBOR zzgl. 0,298 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung	Variabler Zinssatz entspricht 3-Month USD-LIBOR basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung	14.10.2030	65.900	47.343	287	(176)	111	0,00
						$ 582	$ (150)	$ 432	0,00

ZINSSWAPS

Kontrahent	Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Markt-wert	% des Nettovermögens
BOA	Erhalt	3-Month MYR-KLIBOR	3,500 %	15.03.2028	MYR 596.458	$ (227)	$ 1.113	$ 886	0,01
	Erhalt	3-Month MYR-KLIBOR	3,750	15.03.2033	227.400	(66)	579	513	0,01
BPS	Erhalt	3-Month MYR-KLIBOR	3,500	15.03.2028	197.614	(79)	373	294	0,00
GLM	Erhalt	3-Month MYR-KLIBOR	3,545	05.05.2028	130.664	0	154	154	0,00
	Erhalt	3-Month MYR-KLIBOR	3,635	05.04.2024	265.697	(61)	41	(20)	0,00
	Erhalt	3-Month MYR-KLIBOR	3,750	15.03.2033	56.073	117	9	126	0,00
GST	Erhalt	3-Month MYR-KLIBOR	3,500	15.03.2028	30.196	(11)	56	45	0,00
SCX	Erhalt	3-Month MYR-KLIBOR	3,750	15.03.2028	119.180	(359)	253	(106)	0,00
						$ (686)	$ 2.578	$ 1.892	0,02

DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung		Zu erhaltende Währung		Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
AZD	07.2023	AUD	1.137	$	744	$ 0	$ (13)	$ (13)	0,00
	07.2023	NZD	584		355	0	(3)	(3)	0,00
	07.2023	$	5.026	AUD	7.574	16	0	16	0,00
	07.2023		344	NZD	559	0	(1)	(1)	0,00
	08.2023	AUD	7.574	$	5.030	0	(16)	(16)	0,00
BOA	07.2023		19.442		12.688	0	(253)	(253)	0,00
	07.2023	BRL	248		50	0	(1)	(1)	0,00
	07.2023	CAD	146.368		107.569	0	(3.043)	(3.043)	(0,02)
	07.2023	€	670.992		721.118	0	(10.935)	(10.935)	(0,09)
	07.2023	IDR	3.728.820		250	2	0	2	0,00

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung		Zu erhaltende Währung		Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
	07.2023	KRW	899.153	$	700	$ 17	$ 0	$ 17	0,00
	07.2023	NOK	1.365		124	0	(4)	(4)	0,00
	07.2023	NZD	22.612		13.719	0	(134)	(134)	0,00
	07.2023	SEK	500		46	0	0	0	0,00
	07.2023	$	8.475	CAD	11.319	79	(1)	78	0,00
	07.2023		141.207	DKK	960.098	0	(530)	(530)	0,00
	07.2023		1.862	€	1.704	0	(3)	(3)	0,00
	07.2023		28.630	£	22.634	146	0	146	0,00
	07.2023		100	KRW	130.710	0	(1)	(1)	0,00
	07.2023		16.091	MXN	296.227	1.138	0	1.138	0,01
	07.2023		63.791	NOK	701.238	1.662	0	1.662	0,01
	08.2023	DKK	958.495	$	141.207	532	0	532	0,00
	08.2023	IDR	5.634.813		375	0	0	0	0,00
	08.2023	¥	15.293.337		110.915	4.226	0	4.226	0,03
	08.2023	KRW	65.888		50	0	0	0	0,00
	08.2023	TWD	449.705		14.781	339	0	339	0,00
	08.2023	$	357	CNY	2.448	0	(18)	(18)	0,00
	09.2023	¥	46.240.000	$	337.519	14.536	0	14.536	0,12
	09.2023	KRW	41.122.743		32.458	1.116	0	1.116	0,01
	09.2023	TWD	701.820		23.119	538	0	538	0,00
	09.2023	$	12.765	IDR	191.086.376	0	(73)	(73)	0,00
	09.2023		26.402	INR	2.183.759	143	0	143	0,00
BPS	07.2023	AUD	20.419	$	13.642	50	0	50	0,00
	07.2023	CAD	15.425		11.622	16	(51)	(35)	0,00
	07.2023	CHF	174		195	0	0	0	0,00
	07.2023	CZK	23.893		1.111	14	0	14	0,00
	07.2023	DKK	61.825		8.907	0	(152)	(152)	0,00
	07.2023	€	1.408.838		1.514.744	51	(22.351)	(22.300)	(0,18)
	07.2023	ILS	8.989		2.820	397	0	397	0,00
	07.2023	¥	14.201.368		102.216	3.961	0	3.961	0,03
	07.2023	MYR	30.459		6.636	98	0	98	0,00
	07.2023	NOK	165.409		15.383	0	(56)	(56)	0,00
	07.2023	NZD	21.503		13.233	64	(5)	59	0,00
	07.2023	$	6.324	AUD	9.594	62	0	62	0,00
	07.2023		65	BRL	317	0	0	0	0,00
	07.2023		74.363	€	67.647	0	(560)	(560)	0,00
	07.2023		19.086	£	15.253	350	(45)	305	0,00
	07.2023		7.567	¥	1.051.813	0	(290)	(290)	0,00
	07.2023		414	NZD	688	8	0	8	0,00
	08.2023	AUD	5.415	$	3.589	0	(18)	(18)	0,00
	08.2023	BRL	317		65	0	0	0	0,00
	08.2023	CNH	583.431		82.698	2.236	0	2.236	0,02
	08.2023	COP	20.000.000		4.360	0	(354)	(354)	0,00
	08.2023	TWD	351.285		11.506	225	0	225	0,00
	08.2023		$ 195	CHF	174	0	0	0	0,00
	08.2023		421	CNY	2.878	0	(23)	(23)	0,00
	08.2023		15.259	NOK	163.888	54	0	54	0,00
	09.2023	IDR	696.653	$	46	0	0	0	0,00
	09.2023	THB	76		2	0	0	0	0,00
	10.2023	ZAR	8.451		454	11	0	11	0,00
BRC	07.2023	BRL	121		25	0	0	0	0,00
	07.2023	£	7.205		8.944	0	(216)	(216)	0,00
	07.2023	IDR	744.695		50	0	0	0	0,00
	07.2023	¥	51.240.000		396.159	40.954	0	40.954	0,33
	07.2023	NZD	709		426	0	(9)	(9)	0,00
	07.2023	$	19.627	£	15.591	198	(3)	195	0,00
	07.2023		461	NZD	756	2	0	2	0,00
	09.2023	IDR	722.461	$	48	0	0	0	0,00
	09.2023	ILS	27.435		7.670	256	0	256	0,00
	09.2023	$	1.843	IDR	27.659.710	0	(6)	(6)	0,00
	09.2023		6.266	THB	218.569	0	(55)	(55)	0,00
	04.2024	¥	8.140.195	$	66.630	7.785	0	7.785	0,06
	05.2024		5.580.000		45.133	4.610	0	4.610	0,04
CBK	07.2023	AUD	7.776		5.073	0	(103)	(103)	0,00
	07.2023	CZK	21.086		978	11	0	11	0,00
	07.2023	DKK	469.087		67.384	0	(1.348)	(1.348)	(0,01)
	07.2023	IDR	14.521.350		975	9	0	9	0,00
	07.2023	ILS	9.431		2.966	425	0	425	0,00
	07.2023	KRW	195.713		150	1	0	1	0,00
	07.2023	NOK	1.330		120	0	(4)	(4)	0,00
	07.2023	NZD	845		518	1	0	1	0,00
	07.2023	RON	1.376		304	2	0	2	0,00
	07.2023		1.129	AUD	1.688	0	(6)	(6)	0,00
	07.2023		25	BRL	121	0	0	0	0,00
	07.2023		515	CAD	703	16	0	16	0,00
	07.2023		11.171	CLP	9.040.413	87	0	87	0,00
	07.2023		417.541	€	384.064	1.525	(51)	1.474	0,01
	07.2023		9.033	£	7.104	2	(4)	(2)	0,00
	07.2023		11.661	NOK	129.901	464	0	464	0,00
	08.2023	BRL	18.431	$	3.566	0	(236)	(236)	0,00
	08.2023	€	350.430		381.526	0	(1.318)	(1.318)	(0,01)
	08.2023		¥ 33.690.553		244.448	9.417	0	9.417	0,08

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung		Zu erhaltende Währung		Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
	08.2023	TWD	365.728	$	11.981	$ 236	$ 0	$ 236	0,00
	08.2023	$	1.378	CNH	9.610	0	(53)	(53)	0,00
	08.2023		677	ZAR	12.508	0	(18)	(18)	0,00
	09.2023	CNH	13.334	$	1.871	27	0	27	0,00
	09.2023	$	312	KRW	401.547	0	(6)	(6)	0,00
	09.2023		3.485	THB	119.974	0	(76)	(76)	0,00
	10.2023	CLP	3.904.732	$	4.764	0	(45)	(45)	0,00
	10.2023	$	8.206	CLP	6.703.029	49	0	49	0,00
	11.2023	ILS	101.207	$	30.243	2.789	0	2.789	0,02
FAR	07.2023	$	17	CLP	13.870	0	0	0	0,00
GLM	07.2023	BRL	304.543	$	63.731	600	0	600	0,01
	07.2023	IDR	13.463.100		900	5	0	5	0,00
	07.2023	KRW	193.573		150	3	0	3	0,00
	07.2023	NOK	1.011.772		93.870	0	(569)	(569)	0,00
	07.2023	SGD	498		369	1	0	1	0,00
	07.2023	$	56.406	BRL	303.740	6.558	0	6.558	0,05
	07.2023		50	KRW	66.248	0	0	0	0,00
	07.2023		251	MXN	4.415	6	0	6	0,00
	08.2023	CNH	201.680	$	28.707	883	0	883	0,01
	08.2023	$	63.606	BRL	305.488	0	(587)	(587)	0,00
	08.2023		93.870	NOK	1.010.777	572	0	572	0,01
	08.2023		1.531	ZAR	28.414	0	(33)	(33)	0,00
	09.2023	CNH	192.043	$	26.956	394	0	394	0,00
	09.2023	$	56.437	SGD	75.468	0	(512)	(512)	0,00
	09.2023		40.002	THB	1.378.061	0	(841)	(841)	(0,01)
	10.2023	ZAR	2.164	$	115	2	0	2	0,00
IND	07.2023	BRL	242		50	0	0	0	0,00
	07.2023	DKK	1.554.364		224.362	0	(3.388)	(3.388)	(0,03)
	07.2023	KRW	194.309		150	2	0	2	0,00
	07.2023	$	546	SGD	723	0	(11)	(11)	0,00
	08.2023	CNH	53.735	$	7.579	168	0	168	0,00
JPM	07.2023	AUD	17.304		11.313	0	(205)	(205)	0,00
	07.2023	KRW	173.842.951		136.116	4.086	0	4.086	0,03
	07.2023	MXN	2.641		153	0	0	0	0,00
	07.2023	SGD	21.675		16.406	383	0	383	0,00
	07.2023	$	2.421	CAD	3.211	6	0	6	0,00
	07.2023		1.790.126	€	1.639.578	124	(1.470)	(1.346)	(0,01)
	07.2023		666.422	£	527.065	3.664	0	3.664	0,03
	07.2023		31.169	¥	4.457.527	0	(329)	(329)	0,00
	07.2023		50	KRW	66.248	0	0	0	0,00
	07.2023		201	MXN	3.532	5	0	5	0,00
	07.2023		64.146	NZD	105.260	342	0	342	0,00
	07.2023		2.061	SGD	2.723	0	(48)	(48)	0,00
	08.2023	CNH	83.473	$	11.798	286	0	286	0,00
	08.2023	€	1.633.917		1.786.568	1.524	0	1.524	0,01
	08.2023	£	527.065		666.563	0	(3.656)	(3.656)	(0,03)
	08.2023	¥	18.014.696		129.593	4.045	0	4.045	0,03
	08.2023	NZD	105.260		64.140	0	(339)	(339)	0,00
	08.2023	$	444	CNY	3.037	0	(24)	(24)	0,00
	08.2023		554	HUF	192.394	3	(1)	2	0,00
	08.2023		204	MXN	3.540	1	0	1	0,00
	09.2023	IDR	29.932	$	2	0	0	0	0,00
	09.2023	ILS	26.327		7.412	297	0	297	0,00
	09.2023	PEN	65.653		17.831	0	(173)	(173)	0,00
	09.2023	$	5.313	IDR	79.933.034	0	(3)	(3)	0,00
	09.2023		10.257	INR	845.296	18	0	18	0,00
	09.2023		382	KRW	496.689	0	(3)	(3)	0,00
	09.2023		270	MXN	4.684	0	(1)	(1)	0,00
	09.2023		1.635	SGD	2.187	0	(15)	(15)	0,00
	09.2023		12.787	THB	438.491	0	(326)	(326)	0,00
	10.2023		158	ZAR	2.953	0	(3)	(3)	0,00
	12.2023		62.001	INR	5.116.400	0	(22)	(22)	0,00
	10.2024	¥	7.740.000	$	62.332	4.924	0	4.924	0,04
MBC	07.2023	CAD	97.861		73.004	0	(951)	(951)	(0,01)
	07.2023	€	14.493		15.571	0	(241)	(241)	0,00
	07.2023	£	36.632		46.841	268	0	268	0,00
	07.2023	¥	16.730.000		128.100	12.019	0	12.019	0,10
	07.2023	NOK	92.305		8.704	88	0	88	0,00
	07.2023	SGD	1.277		951	7	0	7	0,00
	07.2023	$	24.097	AUD	36.110	0	(61)	(61)	0,00
	07.2023		130.082	CAD	174.416	1.756	(30)	1.726	0,01
	07.2023		10.269	€	9.564	169	(4)	165	0,00
	07.2023		19.312	£	15.497	390	0	390	0,00
	07.2023		5.695	¥	818.600	0	(31)	(31)	0,00
	08.2023	CNH	291.997	$	41.895	1.605	0	1.605	0,01
	08.2023	¥	104.660.000		766.107	36.782	0	36.782	0,29
	08.2023	$	249	ZAR	4.668	0	(3)	(3)	0,00
	09.2023	IDR	70.520	$	5	0	0	0	0,00
	09.2023	¥	4.870.000		35.475	1.426	0	1.426	0,01
	09.2023	KRW	75.933.081		59.541	1.670	0	1.670	0,01
	09.2023	$	1.827	IDR	27.200.022	0	(20)	(20)	0,00

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung		Zu erhaltende Währung		Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
	02.2024	¥	700.018	$	5.675	$ 663	$ 0	$ 663	0,01
	03.2024		15.550.388		127.046	15.190	0	15.190	0,12
	10.2024		10.172.450		81.581	6.132	0	6.132	0,05
MYI	07.2023	€	2.228		2.426	0	(4)	(4)	0,00
	07.2023	£	562.571		699.204	0	(16.022)	(16.022)	(0,13)
	07.2023	IDR	68.027.969		4.543	10	0	10	0,00
	07.2023	KRW	905.289		700	12	0	12	0,00
	07.2023	NOK	624		58	0	(1)	(1)	0,00
	07.2023	NZD	1.996		1.208	0	(15)	(15)	0,00
	07.2023	SEK	25.249		2.352	15	0	15	0,00
	07.2023	$	5.067	CAD	6.674	4	(27)	(23)	0,00
	07.2023		1.032	CHF	928	5	0	5	0,00
	07.2023		125.524	DKK	856.238	0	(65)	(65)	0,00
	07.2023		15.632	€	14.338	11	0	11	0,00
	07.2023		4.705	£	3.702	7	(6)	1	0,00
	07.2023		3.352	IDR	50.372.672	8	0	8	0,00
	07.2023		50	KRW	65.085	0	(1)	(1)	0,00
	07.2023		2.403	SEK	25.946	0	(1)	(1)	0,00
	08.2023	DKK	854.810	$	125.524	66	0	66	0,00
	08.2023	IDR	2.991.960		200	1	0	1	0,00
	08.2023	SEK	25.733		2.386	1	0	1	0,00
	08.2023	TWD	1.973.959		64.804	1.411	0	1.411	0,01
	08.2023	$	618	ZAR	11.585	0	(7)	(7)	0,00
	09.2023	KRW	85.336.510	$	66.683	1.645	0	1.645	0,01
	09.2023	$	18.251	IDR	272.682.426	0	(138)	(138)	0,00
	09.2023		2.214	INR	182.579	6	0	6	0,00
	09.2023		5.838	THB	199.874	0	(158)	(158)	0,00
	10.2023		417	ZAR	7.798	0	(9)	(9)	0,00
RBC	07.2023	CAD	66	$	50	0	0	0	0,00
	07.2023	KRW	65.282		50	0	0	0	0,00
	07.2023	MXN	483.259		25.116	0	(3.013)	(3.013)	(0,02)
	07.2023	$	1.536	AUD	2.369	41	0	41	0,00
	07.2023		452	CAD	616	14	0	14	0,00
	08.2023		24.406	MXN	422.963	57	0	57	0,00
RYL	07.2023	NZD	715	$	442	3	0	3	0,00
	07.2023	$	368	NZD	592	0	(5)	(5)	0,00
SCX	07.2023	AUD	24.427	$	15.961	0	(298)	(298)	0,00
	07.2023	CHF	425		468	0	(7)	(7)	0,00
	07.2023	MYR	30.458		6.627	89	0	89	0,00
	07.2023	NOK	2.700		245	0	(7)	(7)	0,00
	07.2023	NZD	58.891		35.756	0	(324)	(324)	0,00
	07.2023	$	7.385	AUD	11.125	20	0	20	0,00
	07.2023		25	BRL	123	0	0	0	0,00
	07.2023		4.970	CAD	6.750	131	0	131	0,00
	07.2023		408	CHF	367	2	0	2	0,00
	08.2023	AUD	11.125	$	7.391	0	(20)	(20)	0,00
	08.2023	CNH	9.683		1.406	71	0	71	0,00
	08.2023	TWD	1.258.228		41.205	798	0	798	0,01
	08.2023	$	1.181	CNY	8.063	0	(66)	(66)	0,00
	09.2023	CNH	108.227	$	15.167	198	0	198	0,00
	09.2023	IDR	30.357.959		2.041	25	0	25	0,00
	09.2023	TWD	589.168		19.325	369	0	369	0,00
	09.2023	$	18.033	IDR	270.631.595	0	(57)	(57)	0,00
	09.2023		6.419	INR	528.663	7	0	7	0,00
	09.2023		25.919	KRW	33.016.087	0	(756)	(756)	(0,01)
	09.2023		13.561	THB	468.253	0	(254)	(254)	0,00
SOG	07.2023	AUD	7.510	$	4.913	0	(86)	(86)	0,00
	07.2023	BRL	120		25	0	0	0	0,00
	07.2023	SGD	5		4	0	0	0	0,00
	07.2023	$	175	BRL	854	2	0	2	0,00
	07.2023		772	PLN	3.326	46	0	46	0,00
SSB	07.2023	CLP	18.405.696	$	22.722	0	(170)	(170)	0,00
	08.2023	¥	27.020.000		203.550	15.467	0	15.467	0,12
	08.2023	$	7.196	CLP	5.797.132	0	(1)	(1)	0,00
	09.2023	KRW	81.008.828	$	62.458	718	0	718	0,01
	09.2023	$	7.147	BRL	36.231	281	0	281	0,00
TOR	07.2023	AUD	3.974	$	2.599	0	(46)	(46)	0,00
	07.2023	$	9.043	AUD	13.691	71	0	71	0,00
	07.2023		44.725	CAD	59.180	31	(33)	(2)	0,00
	07.2023		54.686	¥	7.872.885	0	(215)	(215)	0,00
	08.2023	AUD	13.691	$	9.051	0	(70)	(70)	0,00
	08.2023	CAD	59.157		44.725	33	(31)	2	0,00
	08.2023	¥	7.779.552		54.255	203	0	203	0,00
	08.2023	$	214	HUF	74.978	3	0	3	0,00
	09.2023	¥	36.380.000	$	258.195	3.269	0	3.269	0,03
UAG	07.2023	AUD	910		596	0	(10)	(10)	0,00
	07.2023	CHF	687		764	0	(4)	(4)	0,00
	07.2023	¥	28.330.000		216.110	19.958	0	19.958	0,16
	07.2023	$	14.570	AUD	21.821	30	(76)	(46)	0,00
	07.2023		247	MXN	4.396	9	0	9	0,00
	07.2023		44.328	NOK	490.507	1.456	0	1.456	0,01
	08.2023	AUD	21.821	$	14.582	75	(30)	45	0,00

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
	08.2023	$ 3.764	CNH 26.091	$ 0	$ (166)	$ (166)	0,00
	08.2023	1.021	ZAR 18.689	0	(35)	(35)	0,00
	09.2023	CNH 81.161	THB 393.063	0	(56)	(56)	0,00
	09.2023	ILS 22.785	$ 6.364	207	0	207	0,00
	09.2023	SGD 57.024	42.667	411	0	411	0,00
	09.2023	$ 24.989	INR 2.065.904	122	0	122	0,00
				$ 255.439	$ (78.681)	$ 176.758	1,40

ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklasse Institutional CAD (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2023	$ 13.013	CAD 17.706	$ 368	$ 0	$ 368	0,00
CBK	07.2023	13.085	17.830	390	0	390	0,01
JPM	07.2023	13.035	17.683	329	0	329	0,00
MBC	07.2023	CAD 605	$ 447	0	(11)	(11)	0,00
	07.2023	$ 300	CAD 402	4	0	4	0,00
UAG	07.2023	623	850	19	0	19	0,00
				$ 1.110	$ (11)	$ 1.099	0,01

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklassen Institutional CHF (Hedged) thesaurierend, Institutional CHF (Hedged) ausschüttend, Investor CHF (Hedged) thesaurierend, E Class CHF (Hedged) thesaurierend, W Class CHF (Hedged) thesaurierend und W Class CHF (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2023	CHF 21	$ 23	$ 0	$ 0	$ 0	0,00
	07.2023	$ 383	CHF 343	0	0	0	0,00
BPS	07.2023	CHF 229.405	$ 256.504	86	0	86	0,00
	07.2023	$ 259.072	CHF 234.190	2.695	0	2.695	0,02
	08.2023	256.479	228.730	0	(87)	(87)	0,00
GLM	07.2023	49.977	45.312	671	0	671	0,01
IND	07.2023	CHF 121.237	$ 134.969	0	(544)	(544)	(0,01)
	08.2023	$ 134.969	CHF 120.893	544	0	544	0,00
JPM	07.2023	CHF 101	$ 111	0	(1)	(1)	0,00
MBC	07.2023	421	467	0	(4)	(4)	0,00
	07.2023	$ 300	CHF 269	1	0	1	0,00
MYI	07.2023	CHF 3.050	$ 3.370	0	(40)	(40)	0,00
	07.2023	$ 103	CHF 94	1	0	1	0,00
RBC	07.2023	CHF 333	$ 372	1	0	1	0,00
RYL	07.2023	122	136	0	(1)	(1)	0,00
SCX	07.2023	4	5	0	0	0	0,00
	07.2023	$ 278.966	CHF 250.916	1.497	0	1.497	0,01
UAG	07.2023	CHF 237.120	$ 264.520	0	(522)	(522)	0,00
	07.2023	$ 221.765	CHF 199.266	965	0	965	0,01
	08.2023	264.477	236.407	521	0	521	0,00
				$ 6.982	$ (1.199)	$ 5.783	0,04

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklassen Institutional EUR (Currency Exposure) thesaurierend, Institutional GBP (Currency Exposure) thesaurierend, Institutional USD (Currency Exposure) thesaurierend, Institutional USD (Currency Exposure) ausschüttend, E Class USD (Currency Exposure) thesaurierend, E Class USD (Currency Exposure) ausschüttend und H Institutional USD (Currency Exposure) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
AZD	07.2023	AUD 2.175	$ 1.443	$ 0	$ (4)	$ (4)	0,00
	07.2023	$ 270	AUD 412	5	0	5	0,00
	08.2023	1.444	2.175	4	0	4	0,00
BOA	07.2023	CLP 241.528	$ 299	0	(2)	(2)	0,00
	07.2023	DKK 5.589	822	3	0	3	0,00
	07.2023	€ 391	425	0	(2)	(2)	0,00
	07.2023	PEN 1.112	306	0	(1)	(1)	0,00
	07.2023	SEK 28.622	2.652	2	0	2	0,00
	07.2023	THB 72.441	2.036	0	(7)	(7)	0,00
	07.2023	$ 2.168	AUD 3.320	42	0	42	0,00
	07.2023	23.997	CAD 32.608	645	0	645	0,01
	07.2023	298	CLP 241.516	3	0	3	0,00
	07.2023	22.666	CNY 160.804	0	(508)	(508)	(0,01)
	07.2023	662	COP 2.967.058	49	0	49	0,00
	07.2023	445	DKK 3.079	6	0	6	0,00
	07.2023	465	HUF 162.249	10	0	10	0,00
	07.2023	2.222	¥ 311.031	0	(70)	(70)	0,00
	07.2023	2.976	KRW 3.941.530	16	0	16	0,00
	07.2023	301	NOK 3.313	8	0	8	0,00
	07.2023	373	NZD 615	4	0	4	0,00

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung		Zu erhaltende Währung		Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
	07.2023	$	301	PEN	1.112	$ 6	$ 0	$ 6	0,00
	07.2023		52	SEK	559	0	0	0	0,00
	08.2023		298	CLP	241.528	2	0	2	0,00
	08.2023		4.019	CNY	29.033	0	(5)	(5)	0,00
	08.2023		822	DKK	5.579	0	(3)	(3)	0,00
	08.2023		305	PEN	1.112	1	0	1	0,00
	08.2023		2.652	SEK	28.587	0	(2)	(2)	0,00
	08.2023		2.041	THB	72.441	8	0	8	0,00
BPS	07.2023	AUD	1.788	$	1.182	0	(8)	(8)	0,00
	07.2023	CHF	3.709		4.147	1	0	1	0,00
	07.2023	CNY	164.618		22.787	104	0	104	0,00
	07.2023	€	156.406		171.375	736	0	736	0,01
	07.2023	£	1.073		1.327	0	(37)	(37)	0,00
	07.2023	NOK	809		75	0	0	0	0,00
	07.2023	TWD	3.965		129	2	0	2	0,00
	07.2023	$	617	CNY	4.383	0	(13)	(13)	0,00
	07.2023		1.180	CZK	25.996	14	0	14	0,00
	07.2023		2	DKK	11	0	0	0	0,00
	07.2023		1.402	€	1.284	0	(2)	(2)	0,00
	07.2023		105	£	82	0	(1)	(1)	0,00
	07.2023		89.810	¥	12.483.426	0	(3.440)	(3.440)	(0,03)
	07.2023		33	NZD	55	1	0	1	0,00
	08.2023		1.031	AUD	1.555	5	0	5	0,00
	08.2023		4.147	CHF	3.698	0	(1)	(1)	0,00
	08.2023		22.787	CNY	164.385	0	(60)	(60)	0,00
	08.2023		171.226	€	156.052	0	(740)	(740)	(0,01)
	08.2023		75	NOK	808	0	0	0	0,00
BRC	07.2023	KRW	3.940.645	$	2.986	0	(5)	(5)	0,00
	07.2023	$	2.976	KRW	3.937.810	13	0	13	0,00
	07.2023		1.431	PLN	6.043	56	0	56	0,00
	08.2023		2.986	KRW	3.935.689	5	0	5	0,00
CBK	07.2023	CAD	1.285	$	943	0	(28)	(28)	0,00
	07.2023	€	325		350	0	(5)	(5)	0,00
	07.2023	ILS	3.410		940	21	0	21	0,00
	07.2023	MXN	42.784		2.489	0	(5)	(5)	0,00
	07.2023	$	935	AUD	1.433	19	0	19	0,00
	07.2023		2.233	CNY	15.851	0	(49)	(49)	0,00
	07.2023		193	€	178	1	0	1	0,00
	07.2023		2.378	MXN	42.784	116	0	116	0,00
	07.2023		27	NOK	295	1	0	1	0,00
	07.2023		128	TWD	3.977	0	0	0	0,00
	08.2023	TWD	3.978	$	128	0	0	0	0,00
	08.2023	$	940	ILS	3.407	0	(21)	(21)	0,00
	08.2023		2.476	MXN	42.784	5	0	5	0,00
GLM	07.2023	COP	2.967.058	$	715	5	0	5	0,00
	07.2023	NOK	4.987		463	0	(3)	(3)	0,00
	07.2023	$	2.820	MYR	12.650	0	(110)	(110)	0,00
	07.2023		2.097	THB	72.441	0	(54)	(54)	0,00
	08.2023		708	COP	2.967.058	0	(4)	(4)	0,00
	08.2023		463	NOK	4.982	3	0	3	0,00
IND	07.2023	CHF	94	$	104	0	0	0	0,00
	07.2023	$	1.306	DKK	9.048	20	0	20	0,00
	08.2023		104	CHF	93	0	0	0	0,00
JPM	07.2023	€	7.028	$	7.514	0	(153)	(153)	0,00
	07.2023	¥	4.357.101		30.467	321	0	321	0,00
	07.2023	SGD	99		73	0	0	0	0,00
	07.2023	$	2.085	AUD	3.189	38	0	38	0,00
	08.2023		30.467	¥	4.338.586	0	(323)	(323)	0,00
	08.2023		526	KRW	694.391	2	0	2	0,00
	08.2023		73	SGD	99	0	0	0	0,00
MBC	07.2023	CAD	1.184	$	874	0	(21)	(21)	0,00
	07.2023	€	1.455		1.559	0	(29)	(29)	0,00
	07.2023	$	22.251	CNY	157.934	0	(489)	(489)	0,00
	07.2023		894	€	835	17	0	17	0,00
	07.2023		31.582	£	25.513	854	0	854	0,01
	07.2023		1.416	SGD	1.913	0	(2)	(2)	0,00
MYI	07.2023	CZK	26.030	$	1.200	5	0	5	0,00
	07.2023	DKK	4.984		731	0	0	0	0,00
	07.2023	IDR	56.374.989		3.741	0	(17)	(17)	0,00
	07.2023	MYR	12.650		2.727	16	0	16	0,00
	07.2023	PLN	6.046		1.493	4	0	4	0,00
	07.2023	SGD	1.981		1.466	2	0	2	0,00
	07.2023	$	52	CHF	47	1	0	1	0,00
	07.2023		0	CLP	12	0	0	0	0,00
	07.2023		914	ILS	3.403	3	0	3	0,00
	07.2023		2.611	SEK	28.031	0	(16)	(16)	0,00
	08.2023		1.200	CZK	26.062	0	(5)	(5)	0,00
	08.2023		731	DKK	4.976	0	0	0	0,00
	08.2023		3.741	IDR	56.396.310	8	0	8	0,00
	08.2023		2.730	MYR	12.650	0	(14)	(14)	0,00
	08.2023		1.493	PLN	6.055	0	(5)	(5)	0,00
	08.2023		1.466	SGD	1.979	0	(2)	(2)	0,00

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung		Zu erhaltende Währung		Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
SCX	07.2023	AUD	3.194	$	2.120	$ 0	$ (6)	$ (6)	0,00
	07.2023	IDR	79.551		5	0	0	0	0,00
	07.2023	$	2.941	AUD	4.501	55	0	55	0,00
	07.2023		4.022	CHF	3.614	17	0	17	0,00
	07.2023		972	NZD	1.601	9	0	9	0,00
	08.2023		2.122	AUD	3.194	6	0	6	0,00
SOG	07.2023		1.783		2.725	31	0	31	0,00
	07.2023		175.713	€	163.342	2.493	0	2.493	0,02
TOR	07.2023	AUD	3.931	$	2.596	0	(20)	(20)	0,00
	07.2023	CAD	20.177		15.203	0	(45)	(45)	0,00
	07.2023	£	24.522		31.160	0	(16)	(16)	0,00
	07.2023	HUF	162.573		481	6	0	6	0,00
	07.2023	NZD	2.271		1.383	0	(8)	(8)	0,00
	07.2023	$	943	AUD	1.442	17	0	17	0,00
	08.2023		2.599		3.931	20	0	20	0,00
	08.2023		15.203	CAD	20.169	45	0	45	0,00
	08.2023		31.167	£	24.522	15	0	15	0,00
	08.2023		481	HUF	163.800	0	(6)	(6)	0,00
	08.2023		1.383	NZD	2.271	8	0	8	0,00
UAG	07.2023	AUD	6.265	$	4.183	22	(9)	13	0,00
	07.2023	CHF	91		102	0	0	0	0,00
	07.2023	$	216	AUD	330	4	0	4	0,00
	07.2023		262	CHF	235	1	0	1	0,00
	07.2023		22.223	CNY	156.221	0	(697)	(697)	(0,01)
	07.2023		2	CZK	36	0	0	0	0,00
	07.2023		3.741	IDR	56.160.911	1	0	1	0,00
	07.2023		2.974	KRW	3.921.725	3	0	3	0,00
	07.2023		219	NOK	2.418	7	0	7	0,00
	07.2023		125	SGD	169	0	0	0	0,00
	08.2023		4.187	AUD	6.265	9	(22)	(13)	0,00
	08.2023		102	CHF	91	0	0	0	0,00
						$ 5.982	$ (7.095)	$ (1.113)	(0,01)

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklassen Institutional EUR (Hedged) thesaurierend, Institutional EUR (Hedged) ausschüttend, Investor EUR (Hedged) thesaurierend, E Class EUR (Hedged) thesaurierend, E Class EUR (Hedged) ausschüttend, G Retail EUR (Hedged) ausschüttend, R Class EUR (Hedged) thesaurierend, T Class EUR (Hedged) thesaurierend, W Class EUR (Hedged) thesaurierend und W Class EUR (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung		Zu erhaltende Währung		Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2023	€	4.836	$	5.285	$ 9	$ 0	$ 9	0,00
	07.2023	$	1.298.096	€	1.207.861	19.682	0	19.682	0,16
BPS	07.2023	€	1.220.730	$	1.337.499	5.684	(1)	5.683	0,04
	07.2023	$	1.299.719	€	1.208.995	19.304	(8)	19.296	0,15
	08.2023		1.323.551		1.206.256	0	(5.725)	(5.725)	(0,05)
CBK	07.2023	€	1.238.349	$	1.346.016	20	(5.044)	(5.024)	(0,04)
	07.2023	$	4.690	€	4.347	52	0	52	0,00
	08.2023		1.308.845		1.202.172	4.520	0	4.520	0,04
JPM	07.2023	€	1.202.172	$	1.312.651	1.081	0	1.081	0,01
	07.2023	$	47.005	€	43.964	960	0	960	0,01
	08.2023		1.314.487		1.202.172	0	(1.122)	(1.122)	(0,01)
MBC	07.2023	€	27.560	$	29.628	0	(439)	(439)	0,00
	07.2023	$	8.473	€	7.898	147	(3)	144	0,00
SOG	07.2023		1.298.346		1.206.934	18.420	0	18.420	0,15
						$ 69.879	$ (12.342)	$ 57.537	0,46

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklassen Institutional GBP (Hedged) thesaurierend, Institutional GBP (Hedged) ausschüttend, Investor GBP (Hedged) thesaurierend, W Class GBP (Hedged) thesaurierend und W Class GBP (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung		Zu erhaltende Währung		Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2023	£	43	$	54	$ 0	$ (1)	$ (1)	0,00
	07.2023	$	6.162	£	4.872	32	0	32	0,00
BPS	07.2023	£	30	$	37	0	(1)	(1)	0,00
	07.2023	$	126.704	£	102.436	3.528	0	3.528	0,03
BRC	07.2023	£	14	$	17	0	0	0	0,00
	07.2023	$	3.763	£	3.025	83	0	83	0,00
CBK	07.2023	£	9.279	$	11.709	8	(96)	(88)	0,00
JPM	07.2023		101.323		128.113	0	(704)	(704)	(0,01)
	08.2023	$	128.140	£	101.323	703	0	703	0,01
MBC	07.2023		127.079		102.651	3.426	0	3.426	0,03
MYI	07.2023		126.187		101.529	2.892	0	2.892	0,02
TOR	07.2023	£	102.058	$	129.685	0	(66)	(66)	0,00
	08.2023	$	129.713	£	102.058	64	0	64	0,00
						$ 10.736	$ (868)	$ 9.868	0,08

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklassen Institutional NOK (Hedged) thesaurierend, Investor NOK (Hedged) thesaurierend und W Class NOK (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung		Zu erhaltende Währung		Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2023	$	105.240	NOK	1.161.036	$ 3.132	$ (1)	$ 3.131	0,02
BPS	07.2023	NOK	747.566	$	69.286	0	(492)	(492)	0,00
	08.2023	$	57.195	NOK	614.290	201	0	201	0,00
CBK	07.2023	NOK	189.152	$	17.148	0	(507)	(507)	0,00
	07.2023	$	90.205	NOK	1.014.373	4.476	0	4.476	0,03
GLM	07.2023	NOK	650.360	$	60.339	0	(366)	(366)	0,00
	07.2023	$	185	NOK	1.985	0	0	0	0,00
	08.2023		60.339		649.721	367	0	367	0,00
MBC	07.2023	NOK	133.216	$	12.078	1	(357)	(356)	0,00
	07.2023	$	8	NOK	87	0	0	0	0,00
MYI	07.2023	NOK	2.574	$	241	1	0	1	0,00
	07.2023	$	9	NOK	102	0	0	0	0,00
RYL	07.2023		655		7.059	4	0	4	0,00
SCX	07.2023	NOK	132.468	$	12.086	0	(279)	(279)	0,00
	07.2023	$	32	NOK	340	0	0	0	0,00
TOR	07.2023	NOK	132.532	$	11.970	0	(400)	(400)	0,00
UAG	07.2023	$	80.572	NOK	891.567	2.647	0	2.647	0,02
						$ 10.829	$ (2.402)	$ 8.427	0,07

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklasse Institutional NZD (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung		Zu erhaltende Währung		Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
AZD	07.2023	NZD	3	$	2	$ 0	$ 0	$ 0	0,00
BOA	07.2023	$	31.766	NZD	52.358	311	0	311	0,00
BPS	07.2023	NZD	2.898	$	1.757	0	(19)	(19)	0,00
	07.2023	$	1.214	NZD	1.971	0	(6)	(6)	0,00
BRC	07.2023	NZD	57.640	$	35.051	0	(262)	(262)	0,00
	07.2023	$	23.373	NZD	38.932	479	0	479	0,01
	08.2023		35.047		57.640	262	0	262	0,00
CBK	07.2023	NZD	73	$	45	0	0	0	0,00
DUB	07.2023	$	10	NZD	16	0	0	0	0,00
JPM	07.2023	NZD	56.492	$	34.428	1	(183)	(182)	0,00
	08.2023	$	34.307	NZD	56.301	181	0	181	0,00
MYI	07.2023		25.562		42.236	314	0	314	0,00
RYL	07.2023	NZD	175	$	108	1	0	1	0,00
SCX	07.2023	$	24.427	NZD	40.231	221	0	221	0,00
TOR	07.2023	NZD	58.593	$	35.683	0	(214)	(214)	0,00
	08.2023	$	35.600	NZD	58.463	213	0	213	0,00
						$ 1.983	$ (684)	$ 1.299	0,01

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklassen Institutional SEK (Hedged) thesaurierend und Administrative SEK (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung		Zu erhaltende Währung		Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2023	SEK	450.347	$	41.727	$ 37	$ (3)	$ 34	0,00
	07.2023	$	138	SEK	1.485	1	(1)	0	0,00
	08.2023		40.079		431.992	0	(34)	(34)	0,00
BRC	07.2023	SEK	242	$	23	0	0	0	0,00
CBK	07.2023	$	27.855	SEK	304.232	312	0	312	0,00
GLM	07.2023		87		931	0	(1)	(1)	0,00
MBC	07.2023	SEK	19	$	2	0	0	0	0,00
	07.2023	$	26.972	SEK	290.473	0	(79)	(79)	0,00
MYI	07.2023	SEK	432.715	$	40.079	17	0	17	0,00
	07.2023	$	39.326	SEK	422.165	0	(241)	(241)	0,00
	08.2023		40.079		432.178	0	(17)	(17)	0,00
SCX	07.2023	SEK	480	$	45	0	0	0	0,00
	07.2023	$	27.090	SEK	293.027	39	0	39	0,00
						$ 406	$ (376)	$ 30	0,00

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklassen Institutional SGD (Hedged) thesaurierend, Institutional SGD (Hedged) ausschüttend, M Retail SGD (Hedged) ausschüttend II und W Class SGD (Hedged) ausschüttend II die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BRC	07.2023	$ 65.357	SGD 88.436	$ 0	$ (11)	$ (11)	0,00
GLM	07.2023	SGD 3.029	$ 2.255	17	0	17	0,00
	07.2023	$ 2.524	SGD 3.398	0	(13)	(13)	0,00
JPM	07.2023	SGD 87.984	$ 65.019	7	0	7	0,00
	07.2023	$ 6.906	SGD 9.346	0	0	0	0,00
	08.2023	65.019	87.899	0	(5)	(5)	0,00
MBC	07.2023	62.279	84.154	1	(97)	(96)	0,00
	08.2023	118	159	0	0	0	0,00
MYI	07.2023	SGD 84.903	$ 62.835	100	0	100	0,00
	08.2023	$ 62.762	SGD 84.727	0	(95)	(95)	0,00
UAG	07.2023	SGD 256	$ 191	1	0	1	0,00
	07.2023	$ 63.197	SGD 85.489	0	(28)	(28)	0,00
				$ 126	$ (249)	$ (123)	0,00
Summe Freiverkehrsfinanzderivate						**$ 249.723**	**1,98**

LEERVERKAUFTE WERTPAPIERE

BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
US-REGIERUNGSBEHÖRDEN			
Ginnie Mae, TBA			
4,000 % fällig am 01.08.2053	$ 7.500	$ (7.103)	(0,06)
Uniform Mortgage-Backed Security, TBA			
2,000 % fällig am 01.07.2038	199.400	(176.718)	(1,40)
2,000 % fällig am 01.07.2053	107.526	(87.714)	(0,69)
2,000 % fällig am 01.08.2053	551.624	(450.629)	(3,57)
3,000 % fällig am 01.08.2053	900	(793)	(0,01)
Summe Leerverkaufte Wertpapiere		**$ (722.957)**	**(5,73)**
Summe Anlagen		**$ 15.950.017**	**126,47**
Sonstige Aktiva und Passiva		**$ (3.338.307)**	**(26,47)**
Nettovermögen		**$ 12.611.710**	**100,00**

ERLÄUTERUNGEN ZUR AUFSTELLUNG DES WERTPAPIERBESTANDS (Angaben in Tausend*):

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

^ Das Wertpapier ist in Verzug.

(a) Bei dem Wertpapier handelt es sich um ein Interest Only- („IO“) bzw. IO-Strip.

(b) Wertpapier mit Sachwertausschüttung.

(c) Nullkuponwertpapier.

(d) Der Kupon stellt eine Rendite bis zur Endfälligkeit dar.

(e) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

(f) Mit dem Fonds verbunden.

(g) Bedingt wandelbares Wertpapier.

(h) Eingeschränkte Wertpapiere (31. Dezember 2022: 0,40 %):

Emittentenbeschreibung	Kupon	Fälligkeits-datum	Kauf-datum	Kosten	Markt-wert	% des Nettovermögens
Citigroup, Inc.	3,290 %	17.03.2026	10.03.2022	$ 33.100	$ 31.674	0,25
Deutsche Bank AG	3,729	14.01.2032	21.01.2021	2.005	1.514	0,01
				$ 35.105	$ 33.188	0,26

(i) Wertpapiere mit einem gesamten beizulegenden Zeitwert von 956 USD (31. Dezember 2022: 1.610 USD) wurden zum 30. Juni 2023 gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen als Sicherheit für Pensionsgeschäfte verpfändet.

Barmittel in Höhe von 352.461 USD (31. Dezember 2022: 312.124 USD) wurden zum 30. Juni 2023 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Barmittel in Höhe von 13.960 USD (31. Dezember 2022: 142.980 EUR) wurden zum 30. Juni 2023 gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. als Sicherheit für Finanzderivate verpfändet.

Beizulegender Zeitwert[1]

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 30. Juni 2023 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie[2]	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	$ 0	$ 14.570.392	$ 38.548	$ 14.608.940
Investmentfonds	1.249.595	0	0	1.249.595
Pensionsgeschäfte	0	721.100	0	721.100
Finanzderivate[3]	20.386	72.953	0	93.339
Leerverkaufte Wertpapiere	0	(722.957)	0	(722.957)
Summen	**$ 1.269.981**	**$ 14.641.488**	**$ 38.548**	**$ 15.950.017**

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

Kategorie[2]	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	$ 0	$ 11.352.524	$ 8.573	$ 11.361.097
Investmentfonds	322.306	798.673	0	1.120.979
Pensionsgeschäfte	0	1.346.970	0	1.346.970
Finanzderivate[3]	73.477	(414.644)	0	(341.167)
Leerverkaufte Wertpapiere	0	(721.316)	0	(721.316)
Summen	**$ 395.783**	**$ 12.362.207**	**$ 8.573**	**$ 12.766.563**

[1] Weitere Informationen finden Sie in den Erläuterungen in Erläuterung 3.

[2] Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung des Wertpapierbestands.

[3] Finanzderivate können offene Terminkontrakte, Swap-, Verkaufs- oder Kaufoptionen sowie Devisenterminkontrakte enthalten.

Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2023:

Kontrahent	Kredit-zins	Abrechnungs-datum	Fälligkeits-datum	Kredit-betrag	Verbindlichkeiten aus umgekehrten Pensions-geschäften	% des Nettovermögens
MBC	2,800 %	03.07.2023	TBD[1]	€ (940)	$ (1.025)	(0,01)
	3,750	30.06.2023	TBD[1]	$ (870)	(870)	(0,01)
Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte					**$ (1.895)**	**(0,02)**

[1] Umgekehrtes Pensionsgeschäft mit offener Laufzeit.

Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC-Finanzderivate und -Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2023 und 31. Dezember 2022:

	Zum 30. Jun. 2023			Zum 31. Dez. 2022		
Kontrahent	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-engagement[1]	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-Engagement[1]
AZD	$ 205	$ 330	$ 535	$ (1.118)	$ 1.920	$ 802
BOA	28.610	(25.370)	3.240	(61.601)	51.870	(9.731)
BPS	6.617	(4.950)	1.667	2.102	(1.850)	252
BRC	54.200	(52.340)	1.860	1.917	(1.260)	657
CBK	15.509	(15.390)	119	57.544	(56.500)	1.044
CLY	k. A.	k. A.	k. A.	(438)	0	(438)
DUB	(1.154)	560	(594)	(789)	220	(569)
FAR	(622)	400	(222)	(224)	0	(224)
FBF	k. A.	k. A.	k. A.	40	0	40
GLM	2.854	(2.150)	704	(7.627)	6.700	(927)
GST	45	(40)	5	(287)	280	(7)
HUS	k. A.	k. A.	k. A.	(120)	140	20
IND	(3.209)	3.050	(159)	2.835	(2.760)	75
JPM	14.077	(14.700)	(623)	3.194	(3.600)	(406)
MBC	79.744	(77.560)	2.184	(13.437)	11.460	(1.977)
MYC	(131)	270	139	(35)	350	315
MYI	(10.340)	6.480	(3.860)	(9.902)	7.130	(2.772)
RBC	(2.900)	2.870	(30)	(363)	320	(43)
RYL	2	0	2	2	0	2
SCX	1.374	(420)	954	(36.806)	34.940	(1.866)
SOG	20.906	(15.440)	5.466	394	(300)	94
SSB	16.295	(16.720)	(425)	2.274	(1.930)	344
TOR	2.828	(2.820)	8	(12.186)	12.810	624
UAG	24.813	(22.820)	1.993	(15.867)	14.840	(1.027)

[1] Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären.

Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung des Wertpapierbestands zum 30. Juni 2023:

	30. Jun. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	66,31	67,82
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	49,52	30,98
Sonstige übertragbare Wertpapiere	k. A.	0,69
Investmentfonds	9,91	9,82
Pensionsgeschäfte	5,72	11,79
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	0,18	0,62
Zentral abgerechnete Finanzderivate	(1,42)	(2,82)
Freiverkehrsfinanzderivate	1,98	(0,79)
Leerverkaufte Wertpapiere	(5,73)	(6,32)
Umgekehrte Pensionsgeschäfte	(0,02)	(0,01)

Das Anlageportfolio des Fonds konzentriert sich zum 30. Juni 2023 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	30. Jun. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
Australien	1,33	1,53
Österreich	k. A.	0,07
Brasilien	k. A.	0,00
Kanada	0,50	0,68
Cayman Inseln	2,05	2,31
China	0,07	0,01
Tschechische Republik	0,00	0,00
Dänemark	2,38	2,36
Finnland	0,01	0,01
Frankreich	2,10	2,98
Deutschland	1,91	2,15
Hongkong	0,17	0,25
Ungarn	0,18	0,04
International	0,22	k. A.
Irland	5,24	5,70
Israel	0,48	0,46
Italien	1,07	1,23
Japan	7,95	6,06
Jersey, Kanalinseln	0,07	0,08
Luxemburg	0,56	0,55
Malaysia	0,27	0,60
Mexiko	0,06	0,12
Multinational	0,09	0,10
Niederlande	0,63	1,10
Neuseeland	0,14	0,21
Norwegen	0,20	0,27
Peru	0,15	0,52
Polen	0,28	0,03
Portugal	0,02	0,01
Katar	0,12	0,13
Rumänien	0,64	0,51
Saudi-Arabien	0,69	0,14
Serbien	k. A.	0,22
Singapur	0,08	k. A.
Slowenien	0,18	0,19
Südafrika	k. A.	0,00
Südkorea	2,46	0,98
Spanien	0,72	0,96
Supranational	0,18	0,20
Schweden	0,00	0,00
Schweiz	1,30	1,25
Thailand	k. A.	0,29
Vereinigte Arabische Emirate	0,06	0,07
Großbritannien	6,00	8,24
Vereinigte Staaten	53,63	39,76
Kurzfristige Instrumente	21,64	17,12
Investmentfonds	9,91	9,82
Pensionsgeschäfte	5,72	11,79
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	0,19	0,63
Verkaufsoptionen		
Optionen auf börsengehandelte Terminkontrakte	(0,01)	(0,01)
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	(0,01)	(0,03)
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzkauf	(0,07)	(0,13)
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzverkauf	0,07	k. A.
Zinsswaps — Basisswaps	k. A.	0,01
Zinsswaps	(1,41)	(2,67)
Freiverkehrsfinanzderivate		
Optionskauf		
Zinsswapoptionen	0,04	0,05
Optionen auf Wertpapiere	0,09	0,09
Verkaufsoptionen		
Credit Default Swaptions auf Kreditindizes	k. A.	0,00
Zinsswapoptionen	(0,23)	(0,28)

Anlagen zum Marktwert	30. Jun. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzkauf	k. A.	(0,01)
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	0,00	0,00
Cross-Currency Swaps	0,00	0,00
Zinsswaps	0,02	(0,01)
Devisenterminkontrakte	1,40	(1,70)
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	0,66	1,07
Leerverkaufte Wertpapiere	(5,73)	(6,32)
Sonstige Aktiva und Passiva	(26,47)	(11,79)
Nettovermögen	100,00	100,00

BESCHREIBUNG		PAR (000S)		MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE					
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL					
BANKEN UND FINANZEN					
AerCap Ireland Capital DAC					
1,650 % fällig am 29.10.2024	$	1.000	$	940	0,03
5,772 % fällig am 29.09.2023		1.700		1.698	0,05
AIB Group PLC					
4,625 % fällig am 23.07.2029	€	7.000		7.505	0,22
American Tower Corp.					
5,250 % fällig am 15.07.2028	$	5.000		4.947	0,15
Asian Development Bank					
4,700 % fällig am 12.03.2024	MXN	79.400		4.378	0,13
Aviation Capital Group LLC					
4,125 % fällig am 01.08.2025	$	1.000		935	0,03
Banco de Sabadell S.A.					
1,125 % fällig am 11.03.2027	€	2.700		2.670	0,08
Banco Santander S.A.					
1,849 % fällig am 25.03.2026	$	400		358	0,01
Bank of America Corp.					
2,687 % fällig am 22.04.2032		2.000		1.658	0,05
4,412 % fällig am 24.08.2025	€	1.700		1.862	0,06
4,587 % fällig am 22.09.2026		8.000		8.710	0,26
5,015 % fällig am 22.07.2033	$	6.000		5.873	0,18
Barclays PLC					
2,667 % fällig am 10.03.2032		6.100		4.800	0,14
3,125 % fällig am 17.01.2024	£	1.200		1.498	0,04
4,375 % fällig am 12.01.2026	$	2.900		2.787	0,08
6,224 % fällig am 09.05.2034		10.900		10.864	0,32
BlueHub Loan Fund, Inc.					
2,890 % fällig am 01.01.2027		900		799	0,02
3,099 % fällig am 01.01.2030		1.900		1.558	0,05
BNP Paribas S.A.					
2,219 % fällig am 09.06.2026		3.600		3.331	0,10
4,375 % fällig am 13.01.2029	€	6.500		7.063	0,21
BPCE S.A.					
5,748 % fällig am 19.07.2033	$	6.100		5.962	0,18
Brookfield Finance, Inc.					
2,724 % fällig am 15.04.2031		3.350		2.747	0,08
Caja Rural de Navarra SCC					
0,875 % fällig am 08.05.2025	€	2.000		2.060	0,06
CBRE Global Investors Open-Ended Fund S.C.A. SICAV-SIF Pan European Core Fund					
0,900 % fällig am 12.10.2029		6.000		4.793	0,14
Community Preservation Corp.					
2,867 % fällig am 01.02.2030	$	3.300		2.768	0,08
Cooperatieve Rabobank UA					
3,758 % fällig am 06.04.2033		1.600		1.391	0,04
Coventry Building Society					
0,010 % fällig am 07.07.2028	€	600		548	0,02
CPI Property Group S.A.					
1,500 % fällig am 27.01.2031		2.700		1.606	0,05
1,625 % fällig am 23.04.2027		1.200		957	0,03
1,750 % fällig am 14.01.2030		5.200		3.443	0,10
2,750 % fällig am 22.01.2028	£	1.000		852	0,03
Credit Suisse AG					
0,250 % fällig am 05.01.2026	€	900		878	0,03
3,625 % fällig am 09.09.2024	$	3.800		3.661	0,11
6,500 % fällig am 08.08.2023 (d)		7.200		7.174	0,21
7,500 % fällig am 15.02.2028		4.100		4.359	0,13
CTP NV					
0,500 % fällig am 21.06.2025	€	3.100		3.015	0,09
0,625 % fällig am 27.09.2026		1.200		1.059	0,03
0,875 % fällig am 20.01.2026		1.300		1.211	0,04
1,500 % fällig am 27.09.2031		1.100		838	0,03
Deutsche Bank AG					
0,050 % fällig am 20.11.2024		3.300		3.407	0,10
1,375 % fällig am 17.02.2032		1.800		1.457	0,04
1,625 % fällig am 20.01.2027		2.100		2.038	0,06
1,750 % fällig am 19.11.2030		2.800		2.417	0,07
1,875 % fällig am 23.02.2028		4.100		3.964	0,12
2,222 % fällig am 18.09.2024	$	1.500		1.481	0,04
2,625 % fällig am 16.12.2024	£	600		710	0,02
2,625 % fällig am 12.02.2026	€	300		310	0,01
3,547 % fällig am 18.09.2031	$	500		416	0,01
3,961 % fällig am 26.11.2025		29.500		28.142	0,84
4,100 % fällig am 13.01.2026		4.200		3.934	0,12
DNB Boligkreditt A/S					
0,625 % fällig am 19.06.2025	€	1.600	$	1.640	0,05
Doctors Co. An Interinsurance Exchange					
4,500 % fällig am 18.01.2032	$	600		476	0,01
EQT AB					
2,375 % fällig am 06.04.2028	€	5.000		4.812	0,14
Eurofima Europäische Gesellschaft für die Finanzierung von Eisenbahnmaterial					
3,125 % fällig am 09.11.2031		8.000		8.682	0,26
Europäische Investitionsbank					
0,750 % fällig am 15.07.2027	AUD	5.000		2.868	0,09
3,300 % fällig am 03.02.2028		1.000		632	0,02
Goldman Sachs Group, Inc.					
2,650 % fällig am 21.10.2032	$	6.900		5.627	0,17
3,000 % fällig am 15.03.2024		5.900		5.777	0,17
3,750 % fällig am 30.04.2024	€	3.200		3.493	0,10
4,281 % fällig am 07.02.2025		5.200		5.697	0,17
Hana Bank					
3,750 % fällig am 04.05.2026		16.200		17.502	0,52
HAT Holdings LLC					
3,375 % fällig am 15.06.2026	$	10.940		9.816	0,29
HSBC Holdings PLC					
2,804 % fällig am 24.05.2032		10.000		8.093	0,24
2,999 % fällig am 10.03.2026		300		285	0,01
3,973 % fällig am 22.05.2030		200		180	0,01
4,300 % fällig am 08.03.2026		1.600		1.547	0,05
6,254 % fällig am 09.03.2034		6.300		6.461	0,19
ING Groep NV					
2,125 % fällig am 23.05.2026	€	8.200		8.534	0,26
Inter-American Development Bank					
2,500 % fällig am 14.04.2027	AUD	600		371	0,01
Internationale Bank für Wiederaufbau und Entwicklung					
3,100 % fällig am 14.04.2038	€	4.500		4.856	0,15
JPMorgan Chase & Co.					
2,595 % fällig am 24.02.2026	$	3.900		3.700	0,11
4,565 % fällig am 14.06.2030		5.100		4.905	0,15
4,912 % fällig am 25.07.2033		3.700		3.617	0,11
5,350 % fällig am 01.06.2034		10.600		10.689	0,32
Jyske Realkredit A/S					
1,000 % fällig am 01.10.2023	DKK	180.000		26.225	0,78
1,000 % fällig am 01.04.2024		45.900		6.600	0,20
1,000 % fällig am 01.10.2050		10.610		1.051	0,03
1,500 % fällig am 01.07.2050		0		0	0,00
1,500 % fällig am 01.10.2050		0		0	0,00
1,500 % fällig am 01.10.2053		112.123		11.751	0,35
2,000 % fällig am 01.10.2047		0		0	0,00
Kookmin Bank					
0,052 % fällig am 15.07.2025	€	2.100		2.111	0,06
Lloyds Banking Group PLC					
3,900 % fällig am 12.03.2024	$	500		492	0,01
Logicor Financing SARL					
0,625 % fällig am 17.11.2025	€	3.500		3.350	0,10
Low Income Investment Fund					
3,386 % fällig am 01.07.2026	$	750		705	0,02
3,711 % fällig am 01.07.2029		1.950		1.750	0,05
MDGH GMTN RSC Ltd.					
5,500 % fällig am 28.04.2033		1.400		1.474	0,04
Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc.					
0,978 % fällig am 09.06.2024	€	2.200		2.332	0,07
Mizuho Financial Group, Inc.					
0,956 % fällig am 16.10.2024		4.200		4.405	0,13
6,540 % fällig am 11.09.2024	$	200		200	0,01
Morgan Stanley					
3,622 % fällig am 01.04.2031		14.700		13.254	0,40
Nationwide Building Society					
4,302 % fällig am 08.03.2029		300		278	0,01
4,363 % fällig am 01.08.2024		1.100		1.098	0,03
Nordea Kredit Realkreditaktieselskab					
1,000 % fällig am 01.04.2024	DKK	102.700		14.767	0,44
1,000 % fällig am 01.10.2050		42.499		4.284	0,13
1,500 % fällig am 01.10.2050		0		0	0,00
1,500 % fällig am 01.10.2053		44.294		4.596	0,14
2,000 % fällig am 01.10.2047		0		0	0,00
2,500 % fällig am 01.10.2047		0		0	0,00
Nykredit Realkredit A/S					
0,375 % fällig am 17.01.2028	€	1.400		1.261	0,04
1,000 % fällig am 01.04.2024	DKK	160.400		23.061	0,69
1,000 % fällig am 01.10.2050	DKK	134.587	$	13.927	0,42
1,000 % fällig am 01.10.2053		27		3	0,00
1,500 % fällig am 01.10.2050		0		0	0,00
1,500 % fällig am 01.10.2053		15.128		1.632	0,05
2,000 % fällig am 01.10.2047		0		0	0,00
2,000 % fällig am 01.10.2050		0		0	0,00
2,500 % fällig am 01.10.2047		0		0	0,00
Realkredit Danmark A/S					
1,000 % fällig am 01.01.2024		80.600		11.670	0,35
1,000 % fällig am 01.04.2024		128.400		18.467	0,55
1,000 % fällig am 01.10.2050		24.131		2.542	0,08
1,500 % fällig am 01.10.2053		19.968		2.167	0,06
2,000 % fällig am 01.10.2050		0		0	0,00
Royal Bank of Canada					
0,010 % fällig am 05.10.2028	€	5.600		5.091	0,15
Santander UK Group Holdings PLC					
3,530 % fällig am 25.08.2028		6.100		6.273	0,19
3,625 % fällig am 14.01.2026	£	300		349	0,01
3,823 % fällig am 03.11.2028	$	300		270	0,01
Santander UK PLC					
5,234 % fällig am 12.02.2027	£	700		891	0,03
Sirius Real Estate Ltd.					
1,125 % fällig am 22.06.2026	€	3.300		2.977	0,09
Societe Generale S.A.					
1,488 % fällig am 14.12.2026	$	4.400		3.875	0,12
2,226 % fällig am 21.01.2026		4.500		4.182	0,13
6,691 % fällig am 10.01.2034		8.000		8.150	0,24
Standard Chartered PLC					
2,678 % fällig am 29.06.2032		6.100		4.785	0,14
Sumitomo Mitsui Banking Corp.					
0,010 % fällig am 10.09.2025	€	3.900		3.891	0,12
0,409 % fällig am 07.11.2029		1.300		1.157	0,03
0,550 % fällig am 06.11.2023		1.650		1.780	0,05
2,440 % fällig am 18.06.2024	$	1.000		967	0,03
Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd.					
0,010 % fällig am 15.10.2027	€	2.500		2.317	0,07
Toronto-Dominion Bank					
5,565 % fällig am 12.06.2028	£	6.200		7.889	0,24
UBS Group AG					
2,593 % fällig am 11.09.2025	$	2.080		1.983	0,06
2,875 % fällig am 02.04.2032	€	8.100		7.713	0,23
3,750 % fällig am 26.03.2025	$	250		239	0,01
3,869 % fällig am 12.01.2029		2.000		1.810	0,05
4,177 % fällig am 16.01.2026	€	340		365	0,01
4,194 % fällig am 01.04.2031	$	1.800		1.603	0,05
4,550 % fällig am 17.04.2026		1.950		1.876	0,06
6,442 % fällig am 11.08.2028		2.650		2.662	0,08
6,537 % fällig am 12.08.2033		4.500		4.613	0,14
7,750 % fällig am 01.03.2029	€	2.100		2.541	0,08
9,016 % fällig am 15.11.2033	$	5.700		6.837	0,20
UniCredit SpA					
3,127 % fällig am 03.06.2032		4.700		3.711	0,11
Vanke Real Estate Hong Kong Co. Ltd.					
3,150 % fällig am 12.05.2025		700		654	0,02
Workspace Group PLC					
2,250 % fällig am 11.03.2028	£	2.300		2.144	0,06
				561.140	16,77
INDUSTRIEWERTE					
Broadcom, Inc.					
2,450 % fällig am 15.02.2031	$	1.600		1.302	0,04
3,419 % fällig am 15.04.2033		800		669	0,02
Continental Wind LLC					
6,000 % fällig am 28.02.2033		1.658		1.676	0,05
Dell International LLC					
6,200 % fällig am 15.07.2030		2.500		2.599	0,08
Ford Motor Co.					
3,250 % fällig am 12.02.2032		3.900		3.072	0,09
Lendlease Europe Finance PLC					
3,500 % fällig am 02.12.2033	£	1.798		1.497	0,05
Nissan Motor Co. Ltd.					
1,940 % fällig am 15.09.2023	€	400		435	0,01
Oracle Corp.					
4,500 % fällig am 06.05.2028	$	10.100		9.831	0,30
4,900 % fällig am 06.02.2033		7.900		7.671	0,23
Pfizer Investment Enterprises Pte. Ltd.					
4,450 % fällig am 19.05.2028		3.300		3.245	0,10
5,110 % fällig am 19.05.2043		3.100		3.109	0,09

BESCHREIBUNG		PAR (000S)		MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
T-Mobile USA, Inc.					
5,050 % fällig am 15.07.2033	$	7.600	$	7.466	0,22
ZF North America Capital, Inc.					
6,875 % fällig am 14.04.2028		2.700		2.737	0,08
7,125 % fällig am 14.04.2030		3.400		3.462	0,10
				48.771	1,46
VERSORGUNGSUNTERNEHMEN					
AES Corp.					
5,450 % fällig am 01.06.2028		11.700		11.499	0,34
Electricite de France S.A.					
6,250 % fällig am 23.05.2033		4.000		4.069	0,12
6,900 % fällig am 23.05.2053		3.000		3.112	0,09
National Grid PLC					
5,809 % fällig am 12.06.2033		3.800		3.869	0,12
Pacific Gas & Electric Co.					
6,700 % fällig am 01.04.2053		8.000		7.862	0,24
Southern Power Co.					
0,900 % fällig am 15.01.2026		6.000		5.380	0,16
Verizon Communications, Inc.					
5,050 % fällig am 09.05.2033		5.400		5.343	0,16
				41.134	1,23
Summe Unternehmensanleihen und Wechsel				651.045	19,46
KOMMUNALANLEIHEN UND WECHSEL					
California State General Obligation Bonds, Series 2023					
5,125 % fällig am 01.03.2038		3.600		3.623	0,11
US-REGIERUNGSBEHÖRDEN					
Fannie Mae					
3,000 % fällig am 01.03.2060		1.090		964	0,03
3,500 % fällig am 01.01.2059		640		584	0,02
Freddie Mac					
3,500 % fällig am 01.05.2048		5.320		4.919	0,15
4,000 % fällig am 01.06.2048		3.877		3.714	0,11
Ginnie Mae					
3,000 % fällig am 20.07.2046 - 20.05.2047		23		21	0,00
6,464 % fällig am 20.04.2067		199		198	0,01
Uniform Mortgage-Backed Security					
2,500 % fällig am 01.12.2051 - 01.03.2052		47.565		40.419	1,21
3,000 % fällig am 01.07.2052		8.161		7.196	0,22
3,500 % fällig am 01.03.2047 - 01.04.2053		29.260		26.733	0,80
4,000 % fällig am 01.07.2048 - 01.07.2053		129.473		121.637	3,64
4,500 % fällig am 01.12.2052 - 01.06.2053		44.738		43.039	1,29
5,000 % fällig am 01.02.2053		138.219		135.521	4,05
5,500 % fällig am 01.02.2053		85.073		84.715	2,53
6,000 % fällig am 01.01.2053		41.263		41.644	1,24
6,500 % fällig am 01.01.2053		22.200		22.682	0,68
Uniform Mortgage-Backed Security, TBA					
2,500 % fällig am 01.08.2053		13.000		11.042	0,33
4,500 % fällig am 01.08.2053		111.400		107.162	3,20
5,500 % fällig am 01.08.2053		100.000		99.508	2,97
6,000 % fällig am 01.07.2053		192.600		194.270	5,81
6,500 % fällig am 01.07.2053		214.400		218.923	6,53
				1.164.891	34,82
US-SCHATZOBLIGATIONEN					
U.S. Treasury Bonds					
1,625 % fällig am 15.11.2050		10.100		6.278	0,19
1,875 % fällig am 15.02.2041		42.500		30.897	0,92
2,875 % fällig am 15.05.2052		6.900		5.721	0,17
4,000 % fällig am 15.11.2052		5.200		5.343	0,16
U.S. Treasury Inflation Protected Securities (c)					
0,125 % fällig am 15.04.2025		24.777		23.573	0,71
0,125 % fällig am 15.07.2031		16.636		14.759	0,44
0,125 % fällig am 15.01.2032		27.683		24.384	0,73
0,250 % fällig am 15.01.2025		27.020		25.906	0,78
0,500 % fällig am 15.01.2028		10.452		9.780	0,29
0,625 % fällig am 15.07.2032		1.566		1.440	0,04
1,125 % fällig am 15.01.2033		34.722		33.289	1,00
2,500 % fällig am 15.01.2029		4.168		4.293	0,13
3,875 % fällig am 15.04.2029		738		816	0,02

BESCHREIBUNG		PAR (000S)		MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
U.S. Treasury Notes					
0,375 % fällig am 30.09.2027	$	2.900	$	2.469	0,07
0,625 % fällig am 30.11.2027		12.800		10.965	0,33
0,750 % fällig am 31.01.2028		11.700		10.039	0,30
2,875 % fällig am 30.04.2025		4.200		4.045	0,12
				213.997	6,40
NON-AGENCY-MBS					
American Home Mortgage Assets Trust					
4,916 % fällig am 25.10.2046		81		57	0,00
5,340 % fällig am 25.10.2046		1.050		579	0,02
American Home Mortgage Investment Trust					
7,129 % fällig am 25.09.2035		170		76	0,00
Atlas Funding PLC					
5,432 % fällig am 25.07.2058	£	1.712		2.176	0,07
Atrium Hotel Portfolio Trust					
6,373 % fällig am 15.12.2036	$	5.000		4.829	0,14
Avon Finance PLC					
5,809 % fällig am 20.09.2048	£	1.377		1.751	0,05
Bear Stearns ALT-A Trust					
3,817 % fällig am 25.11.2036 ^	$	612		323	0,01
Bear Stearns Mortgage Funding Trust					
5,320 % fällig am 25.06.2047		947		799	0,02
Brass PLC					
5,430 % fällig am 16.11.2066	£	364		464	0,01
Canada Square Funding PLC					
5,682 % fällig am 17.06.2058		1.868		2.362	0,07
5,852 % fällig am 17.06.2058		3.176		4.019	0,12
6,152 % fällig am 17.12.2057		1.386		1.766	0,05
Charter Mortgage Funding PLC					
5,327 % fällig am 16.01.2057		520		660	0,02
Chase Mortgage Finance Trust					
4,529 % fällig am 25.07.2037	$	7		5	0,00
Citigroup Commercial Mortgage Trust					
3,209 % fällig am 10.05.2049		2.100		1.948	0,06
Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.					
3,994 % fällig am 25.12.2035 ^		343		225	0,01
Commercial Mortgage Trust					
3,590 % fällig am 10.11.2047		2.000		1.924	0,06
3,732 % fällig am 10.08.2049		1.000		940	0,03
4,228 % fällig am 10.05.2051		1.700		1.589	0,05
Countrywide Alternative Loan Trust					
5,390 % fällig am 25.06.2036		73		66	0,00
5,500 % fällig am 25.11.2034		120		116	0,00
5,570 % fällig am 25.07.2046 ^		448		372	0,01
5,630 % fällig am 25.08.2047		866		724	0,02
6,250 % fällig am 25.12.2036		1.036		472	0,01
Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust					
5,690 % fällig am 25.04.2046		1.851		539	0,02
5,730 % fällig am 25.03.2035 ^		341		280	0,01
5,830 % fällig am 25.03.2035 ^		69		61	0,00
6,000 % fällig am 25.07.2036		248		135	0,00
6,000 % fällig am 25.12.2036 ^		602		261	0,01
6,000 % fällig am 25.03.2037		598		302	0,01
6,500 % fällig am 25.11.2047		92		50	0,00
Deutsche ALT-A Securities Mortgage Loan Trust					
5,450 % fällig am 25.09.2047 ^		724		616	0,02
5,710 % fällig am 25.08.2036		4.046		3.649	0,11
Dutch Property Finance BV					
3,892 % fällig am 28.07.2058	€	2.249		2.450	0,07
EMF-UK PLC					
5,970 % fällig am 13.03.2046	£	204		257	0,01
Eurohome UK Mortgages PLC					
5,137 % fällig am 15.06.2044		22		27	0,00
EuroMASTR PLC					
5,205 % fällig am 15.06.2040		45		53	0,00
Eurosail PLC					
3,629 % fällig am 13.03.2045	€	29		31	0,00
First Horizon Alternative Mortgage Securities Trust					
6,250 % fällig am 25.11.2036 ^	$	33		11	0,00
Genesis Mortgage Funding PLC					
6,081 % fällig am 15.09.2059	£	8.124		10.347	0,31
GSR Mortgage Loan Trust					
4,481 % fällig am 25.11.2035	$	47		47	0,00
5,024 % fällig am 25.10.2035 ^		22		20	0,00

BESCHREIBUNG		PAR (000S)		MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
Impac Secured Assets Trust					
5,670 % fällig am 25.01.2037	$	463	$	371	0,01
IndyMac Mortgage Loan Trust					
3,916 % fällig am 25.12.2034		118		112	0,00
5,490 % fällig am 25.11.2036		2.443		2.371	0,07
JPMorgan Alternative Loan Trust					
5,630 % fällig am 25.10.2036		228		204	0,01
JPMorgan Mortgage Trust					
4,179 % fällig am 25.08.2035		99		95	0,00
6,000 % fällig am 25.06.2037		768		345	0,01
Lehman XS Trust					
5,476 % fällig am 25.03.2047		436		411	0,01
Ludgate Funding PLC					
4,590 % fällig am 01.01.2061	£	38		45	0,00
5,030 % fällig am 01.01.2061		2.301		2.800	0,08
Merrill Lynch Alternative Note Asset Trust					
2,925 % fällig am 25.10.2047	$	10.448		3.287	0,10
Miravet SARL					
4,265 % fällig am 26.05.2065	€	1.316		1.413	0,04
Mortimer BTL PLC					
5,614 % fällig am 23.06.2053	£	2.245		2.822	0,08
New Residential Mortgage Loan Trust					
3,500 % fällig am 25.12.2057	$	937		879	0,03
Paragon Mortgages PLC					
5,752 % fällig am 15.05.2045	£	108		137	0,00
Polaris PLC					
5,631 % fällig am 23.12.2058		2.069		2.619	0,08
Residential Accredit Loans, Inc. Trust					
5,091 % fällig am 25.11.2037	$	249		208	0,01
5,450 % fällig am 25.06.2037 ^		291		259	0,01
6,000 % fällig am 25.06.2036		365		291	0,01
Residential Mortgage Securities PLC					
6,159 % fällig am 20.06.2070	£	1.188		1.515	0,05
RESIMAC Bastille Trust					
6,093 % fällig am 05.09.2057	$	63		63	0,00
RESIMAC Premier					
6,241 % fällig am 07.02.2052		742		742	0,02
Ripon Mortgages PLC					
5,491 % fällig am 28.08.2056	£	13.845		17.540	0,53
RMAC Securities PLC					
5,154 % fällig am 12.06.2044		34		42	0,00
Sequoia Mortgage Trust					
3,723 % fällig am 20.07.2037	$	189		152	0,01
Stratton Mortgage Funding PLC					
5,391 % fällig am 20.07.2060	£	3.026		3.848	0,12
5,765 % fällig am 12.03.2052		2.011		2.548	0,08
5,792 % fällig am 25.09.2051		2.599		3.297	0,10
Structured Asset Securities Corp.					
5,430 % fällig am 25.01.2036	$	138		109	0,00
Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust					
5,440 % fällig am 25.10.2036		285		239	0,01
TBW Mortgage-Backed Trust					
5,965 % fällig am 25.07.2037		2.345		749	0,02
Towd Point Mortgage Funding PLC					
5,635 % fällig am 20.10.2051	£	661		841	0,03
5,841 % fällig am 20.07.2045		1.058		1.345	0,04
Trinidad Mortgage Securities PLC					
5,443 % fällig am 24.01.2059		92		116	0,00
Trinity Square PLC					
5,316 % fällig am 15.07.2059		1.720		2.184	0,07
Twin Bridges PLC					
5,715 % fällig am 12.03.2055		2.598		3.291	0,10
Uropa Securities PLC					
4,879 % fällig am 10.10.2040		258		310	0,01
WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust					
3,626 % fällig am 25.09.2036	$	59		51	0,00
3,772 % fällig am 25.02.2037 ^		2.721		2.442	0,07
3,800 % fällig am 25.10.2035		82		74	0,00
4,154 % fällig am 25.09.2033		41		39	0,00
4,976 % fällig am 25.02.2046		258		230	0,01
Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates Trust					
5,500 % fällig am 25.04.2035		298		245	0,01
				108.059	3,23

BESCHREIBUNG		PAR (000S)		MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE					
Accunia European CLO DAC					
4,127 % fällig am 15.07.2030	€	355	$	382	0,01
ACE Securities Corp. Home Equity Loan Trust					
6,050 % fällig am 25.12.2034	$	105		94	0,00
6,050 % fällig am 25.08.2035		1.413		1.357	0,04
Adagio CLO DAC					
3,897 % fällig am 15.10.2031	€	2.400		2.568	0,08
Apidos CLO					
6,260 % fällig am 20.04.2031	$	5.900		5.844	0,17
Aqueduct European CLO DAC					
3,840 % fällig am 20.07.2030	€	2.381		2.564	0,08
Ares European CLO DAC					
3,957 % fällig am 15.10.2031		2.700		2.895	0,09
4,050 % fällig am 20.04.2032		4.100		4.389	0,13
Argent Securities Trust					
5,510 % fällig am 25.04.2036	$	5.047		1.670	0,05
Atlas Senior Loan Fund Ltd.					
6,410 % fällig am 16.01.2030		2.851		2.837	0,08
Aurium CLO DAC					
3,907 % fällig am 16.01.2031	€	4.793		5.129	0,15
Bain Capital Euro CLO DAC					
3,940 % fällig am 20.01.2032		1.988		2.122	0,06
Bayview Financial Asset Trust					
6,650 % fällig am 25.03.2037	$	98		98	0,00
Benefit Street Partners CLO Ltd.					
6,350 % fällig am 20.01.2031		2.523		2.503	0,07
Black Diamond CLO DAC					
4,303 % fällig am 15.05.2032	€	4.700		5.017	0,15
BlueMountain Fuji EUR CLO DAC					
3,897 % fällig am 15.01.2031		1.988		2.125	0,06
4,087 % fällig am 15.01.2033		2.850		3.032	0,09
BNPP AM Euro CLO DAC					
4,031 % fällig am 22.07.2032		4.800		5.117	0,15
Bridgepoint CLO DAC					
4,387 % fällig am 15.01.2034		3.400		3.658	0,11
Cairn CLO BV					
3,957 % fällig am 15.10.2031		1.300		1.390	0,04
Cairn CLO DAC					
4,212 % fällig am 20.10.2028		20		22	0,00
Carlyle Euro CLO DAC					
3,877 % fällig am 15.01.2031		2.190		2.339	0,07
4,213 % fällig am 15.08.2032		3.000		3.199	0,10
Carlyle Global Market Strategies CLO Ltd.					
6,230 % fällig am 17.04.2031	$	3.290		3.262	0,10
Carlyle Global Market Strategies Euro CLO Ltd.					
4,073 % fällig am 15.11.2031	€	1.500		1.606	0,05
Carlyle U.S. CLO Ltd.					
6,440 % fällig am 15.01.2030	$	3.609		3.578	0,11
Catamaran CLO Ltd.					
6,373 % fällig am 22.04.2030		3.793		3.770	0,11
Cedar Funding CLO Ltd.					
6,360 % fällig am 17.07.2031		4.400		4.363	0,13
CIFC Funding Ltd.					
6,352 % fällig am 27.04.2031		2.300		2.280	0,07
6,440 % fällig am 16.11.2030		4.431		4.414	0,13
6,460 % fällig am 17.10.2031		3.200		3.170	0,10
CIT Mortgage Loan Trust					
6,500 % fällig am 25.10.2037		452		451	0,01
Countrywide Asset-Backed Certificates Trust					
5,290 % fällig am 25.07.2037		2.010		1.826	0,05
5,370 % fällig am 25.09.2037 ^		182		183	0,01
5,380 % fällig am 25.04.2047		5.700		5.188	0,16
5,400 % fällig am 25.02.2036		580		542	0,02
6,125 % fällig am 25.01.2036		2.072		2.008	0,06
CVC Cordatus Loan Fund DAC					
4,008 % fällig am 27.01.2031	€	5.633		6.034	0,18
Dryden Euro CLO DAC					
4,183 % fällig am 15.05.2034		1.250		1.335	0,04
Encore Credit Receivables Trust					
5,840 % fällig am 25.07.2035	$	454		433	0,01
Fremont Home Loan Trust					
6,215 % fällig am 25.06.2035		136		129	0,00
Gallatin CLO Ltd.					
6,311 % fällig am 21.01.2028		157		157	0,00
Greenwood Park CLO Ltd.					
6,270 % fällig am 15.04.2031	$	2.300	$	2.267	0,07
Griffith Park CLO DAC					
4,103 % fällig am 21.11.2031	€	1.000		1.070	0,03
GSAMP Trust					
5,650 % fällig am 25.05.2046	$	1.329		1.248	0,04
5,870 % fällig am 25.11.2035		4.200		3.398	0,10
Harvest CLO DAC					
3,817 % fällig am 15.10.2031	€	3.200		3.408	0,10
3,880 % fällig am 20.10.2031		1.200		1.283	0,04
3,937 % fällig am 15.07.2031		3.300		3.514	0,11
4,027 % fällig am 15.01.2032		4.700		5.018	0,15
4,250 % fällig am 26.06.2030		2.836		3.032	0,09
Home Equity Asset Trust					
3,883 % fällig am 25.02.2036	$	813		782	0,02
Home Equity Mortgage Loan Asset-Backed Trust					
5,370 % fällig am 25.04.2037		258		192	0,01
7,100 % fällig am 25.03.2035		1.295		1.129	0,03
HSI Asset Securitization Corp. Trust					
5,290 % fällig am 25.01.2037		1.476		1.108	0,03
IndyMac Home Equity Mortgage Loan Asset-Backed Trust					
4,100 % fällig am 25.03.2035		1.896		1.822	0,05
Jubilee CLO DAC					
4,326 % fällig am 15.12.2029	€	352		380	0,01
KKR CLO Ltd.					
6,440 % fällig am 15.01.2031	$	2.902		2.874	0,09
Laurelin DAC					
3,920 % fällig am 20.10.2031	€	1.500		1.607	0,05
Long Beach Mortgage Loan Trust					
5,750 % fällig am 25.01.2036	$	694		624	0,02
LT Autorahoitus DAC					
4,040 % fällig am 18.07.2033	€	6.960		7.599	0,23
Madison Park Euro Funding DAC					
3,927 % fällig am 15.01.2032		3.200		3.418	0,10
3,977 % fällig am 15.07.2032		5.200		5.533	0,17
Madison Park Funding Ltd.					
0,000 % fällig am 29.07.2030	$	1.976		1.969	0,06
Man GLG Euro CLO DAC					
3,987 % fällig am 15.10.2032	€	5.194		5.520	0,17
MASTR Asset-Backed Securities Trust					
5,470 % fällig am 25.08.2036	$	12.354		4.544	0,14
Merrill Lynch Mortgage Investors Trust					
5,390 % fällig am 25.02.2037		633		190	0,01
5,870 % fällig am 25.05.2036		206		203	0,01
Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust					
5,220 % fällig am 25.10.2036		811		353	0,01
5,250 % fällig am 25.11.2036		5.930		2.807	0,08
5,400 % fällig am 25.07.2036		61		52	0,00
5,750 % fällig am 25.12.2034		478		417	0,01
5,825 % fällig am 25.09.2035		3.300		3.062	0,09
6,110 % fällig am 25.09.2034		680		659	0,02
Morgan Stanley Structured Trust					
5,450 % fällig am 25.06.2037		2.798		2.555	0,08
Neuberger Berman Loan Advisers CLO Ltd.					
6,290 % fällig am 20.04.2031		2.500		2.466	0,07
New Century Home Equity Loan Trust					
5,915 % fällig am 25.02.2035		2.460		2.248	0,07
Nomura Home Equity Loan, Inc. Home Equity Loan Trust					
5,780 % fällig am 25.02.2036		4.100		3.640	0,11
NovaStar Mortgage Funding Trust					
5,350 % fällig am 25.01.2037		2.485		871	0,03
5,690 % fällig am 25.05.2036		1.700		1.591	0,05
OCP CLO Ltd.					
6,370 % fällig am 20.07.2029		2.682		2.665	0,08
OCP Euro CLO DAC					
4,091 % fällig am 22.09.2034	€	2.700		2.869	0,09
Option One Mortgage Loan Trust					
5,290 % fällig am 25.01.2037	$	256		167	0,01
5,290 % fällig am 25.03.2037		1.174		805	0,02
5,330 % fällig am 25.04.2037		3.031		1.519	0,05
OZLM Ltd.					
6,270 % fällig am 17.07.2029		1.814		1.809	0,05
6,348 % fällig am 16.05.2030		2.814		2.794	0,08
6,549 % fällig am 30.10.2030		1.064		1.060	0,03
Palmer Square CLO Ltd.					
6,360 % fällig am 16.07.2031		3.500		3.470	0,10
Palmer Square European Loan Funding DAC					
3,897 % fällig am 15.10.2031	€	5.441	$	5.818	0,17
3,907 % fällig am 15.07.2031		4.114		4.383	0,13
Pepper SPARKZ Trust					
5,160 % fällig am 17.08.2028	AUD	536		356	0,01
Renaissance Home Equity Loan Trust					
5,762 % fällig am 25.08.2036	$	708		282	0,01
Residential Asset Securities Corp. Trust					
5,810 % fällig am 25.12.2035		4.997		4.742	0,14
Saxon Asset Securities Trust					
1,942 % fällig am 25.05.2035		3.041		2.795	0,08
Sculptor European CLO DAC					
3,916 % fällig am 14.01.2032	€	4.900		5.252	0,16
Securitized Asset-Backed Receivables LLC Trust					
5,870 % fällig am 25.10.2035	$	5.600		4.486	0,13
Segovia European CLO DAC					
4,080 % fällig am 20.07.2032	€	2.700		2.870	0,09
Soundview Home Loan Trust					
5,555 % fällig am 25.12.2036	$	1.396		1.357	0,04
5,650 % fällig am 25.11.2036		942		874	0,03
Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust					
5,675 % fällig am 25.07.2036		1.129		1.044	0,03
Terwin Mortgage Trust					
6,090 % fällig am 25.11.2033		5		4	0,00
TIAA CLO Ltd.					
6,450 % fällig am 20.07.2031		2.550		2.519	0,08
Toro European CLO DAC					
4,097 % fällig am 15.07.2030	€	312		338	0,01
4,133 % fällig am 15.02.2034		5.000		5.309	0,16
Venture CLO Ltd.					
6,140 % fällig am 15.04.2027	$	97		97	0,00
6,350 % fällig am 20.01.2029		2.747		2.728	0,08
Wells Fargo Home Equity Asset-Backed Securities Trust					
5,495 % fällig am 25.01.2037		2.678		2.566	0,08
				254.511	7,61
STAATSEMISSIONEN					
Adif Alta Velocidad					
0,550 % fällig am 31.10.2031	€	5.000		4.225	0,13
Auckland Council					
0,250 % fällig am 17.11.2031		5.000		4.236	0,13
Australia Government International Bond					
0,500 % fällig am 21.09.2026	AUD	5.800		3.455	0,10
1,000 % fällig am 21.12.2030		2.600		1.399	0,04
1,250 % fällig am 21.05.2032		1.200		635	0,02
1,750 % fällig am 21.06.2051		1.400		543	0,02
4,500 % fällig am 21.04.2033		6.000		4.147	0,12
Autonomous Community of Andalusia					
0,500 % fällig am 30.04.2031	€	4.000		3.451	0,10
Autonomous Community of Catalonia					
4,220 % fällig am 26.04.2035		200		217	0,01
Autonomous Community of Madrid					
0,420 % fällig am 30.04.2031		4.200		3.614	0,11
BNG Bank NV					
0,250 % fällig am 12.01.2032		4.000		3.438	0,10
3,300 % fällig am 17.07.2028	AUD	3.000		1.871	0,06
Bpifrance Financement S.A.					
2,000 % fällig am 02.09.2030	€	4.200		4.232	0,13
Canadian Government Real Return Bond					
1,500 % fällig am 01.12.2044 (c)	CAD	541		409	0,01
Cassa Depositi e Prestiti SpA					
5,750 % fällig am 05.05.2026	$	5.300		5.235	0,16
China Government International Bond					
3,190 % fällig am 15.04.2053	CNY	28.440		4.057	0,12
Communaute Francaise de Belgique					
3,750 % fällig am 22.06.2033	€	16.300		18.206	0,54
CPPIB Capital, Inc.					
1,500 % fällig am 23.06.2028	AUD	2.300		1.306	0,04
Development Bank of Japan, Inc.					
1,875 % fällig am 02.10.2024	$	3.900		3.725	0,11
2,125 % fällig am 01.09.2026	€	6.000		6.232	0,19
France Government International Bond					
0,000 % fällig am 25.11.2029 (a)		9.900		9.035	0,27
0,750 % fällig am 25.05.2052		7.700		4.581	0,14

BESCHREIBUNG		PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
2,000 % fällig am 25.11.2032	€	6.200	$ 6.271	0,19
Hungary Government International Bond				
5,000 % fällig am 22.02.2027		900	989	0,03
6,250 % fällig am 22.09.2032	$	4.900	5.033	0,15
Israel Government International Bond				
1,500 % fällig am 30.11.2023	ILS	64.100	17.056	0,51
2,000 % fällig am 31.03.2027		7.800	1.966	0,06
3,800 % fällig am 13.05.2060	$	1.700	1.295	0,04
4,500 % fällig am 17.01.2033		2.100	2.070	0,06
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro				
4,000 % fällig am 30.10.2031	€	20.000	22.004	0,66
Italy Government International Bond				
6,875 % fällig am 27.09.2023	$	2.100	2.105	0,06
Japan Finance Organization for Municipalities				
0,010 % fällig am 02.02.2028	€	3.600	3.344	0,10
Japan Government International Bond				
0,005 % fällig am 01.03.2024	¥	4.110.000	28.467	0,85
0,005 % fällig am 01.04.2024		1.690.000	11.707	0,35
0,005 % fällig am 01.05.2024		1.370.000	9.490	0,28
0,005 % fällig am 01.10.2024		6.820.000	47.265	1,41
0,100 % fällig am 10.03.2028 (c)		2.944.213	21.470	0,64
0,200 % fällig am 20.06.2036		500.000	3.275	0,10
0,500 % fällig am 20.09.2046		477.000	2.896	0,09
0,500 % fällig am 20.03.2049		2.600.000	15.245	0,46
0,700 % fällig am 20.12.2048		132.000	817	0,02
0,700 % fällig am 20.06.2051		1.502.000	9.048	0,27
1,300 % fällig am 20.06.2052		620.000	4.331	0,13
1,400 % fällig am 20.09.2052		260.000	1.861	0,06
Kommunalbanken A/S				
1,900 % fällig am 19.01.2027	AUD	800	484	0,01
Korea Housing Finance Corp.				
0,010 % fällig am 29.06.2026	€	1.300	1.257	0,04
3,714 % fällig am 11.04.2027		5.000	5.403	0,16
4,475 % fällig am 06.04.2026	AUD	10.900	7.078	0,21
Malaysia Government International Bond				
2,632 % fällig am 15.04.2031	MYR	9.583	1.890	0,06
Malaysia Government Investment Issue				
3,465 % fällig am 15.10.2030		5.724	1.200	0,04
Mexico Government International Bond				
5,000 % fällig am 27.04.2051	$	500	435	0,01
Ministeries van de Vlaamse Gemeenschap				
0,875 % fällig am 21.03.2046	€	3.800	2.418	0,07
New Zealand Government International Bond				
1,500 % fällig am 15.05.2031	NZD	1.500	734	0,02
Ontario Teachers' Finance Trust				
0,900 % fällig am 20.05.2041	€	1.400	1.000	0,03
1,850 % fällig am 03.05.2032		4.000	3.802	0,11
Peru Government International Bond				
2,780 % fällig am 01.12.2060	$	1.500	921	0,03
5,940 % fällig am 12.02.2029	PEN	4.800	1.301	0,04
6,150 % fällig am 12.08.2032		2.100	555	0,02
Poland Government International Bond				
3,875 % fällig am 14.02.2033	€	4.200	4.552	0,14
4,250 % fällig am 14.02.2043		900	966	0,03
4,875 % fällig am 04.10.2033	$	2.200	2.164	0,06
5,500 % fällig am 16.11.2027		600	616	0,02
5,500 % fällig am 04.04.2053		1.600	1.614	0,05

BESCHREIBUNG		PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
Region of Ile de France				
2,230 % fällig am 19.07.2032	€	6.000	$ 5.988	0,18
3,700 % fällig am 14.06.2038		10.000	11.116	0,33
Bundesrepublik Deutschland				
0,000 % fällig am 15.08.2031 (a)		53.800	48.632	1,45
Romania Government International Bond				
1,375 % fällig am 02.12.2029		1.170	993	0,03
2,000 % fällig am 28.01.2032		200	160	0,00
2,000 % fällig am 14.04.2033		400	309	0,01
2,124 % fällig am 16.07.2031		100	83	0,00
2,125 % fällig am 07.03.2028		14.200	13.478	0,40
2,625 % fällig am 02.12.2040		500	333	0,01
2,750 % fällig am 14.04.2041		600	403	0,01
2,875 % fällig am 13.04.2042		2.000	1.345	0,04
3,750 % fällig am 07.02.2034		2.100	1.857	0,06
6,625 % fällig am 27.09.2029		8.600	9.766	0,29
Serbia Government International Bond				
1,000 % fällig am 23.09.2028		3.100	2.625	0,08
1,650 % fällig am 03.03.2033		3.000	2.184	0,06
2,050 % fällig am 23.09.2036		2.550	1.711	0,05
Societe Du Grand Paris EPIC				
0,700 % fällig am 15.10.2060		4.400	1.901	0,06
Societe Nationale SNCF S.A.				
3,125 % fällig am 02.11.2027		5.000	5.379	0,16
South Korea Government International Bond				
2,000 % fällig am 10.06.2031	KRW	34.358.800	23.126	0,69
3,250 % fällig am 10.06.2033		36.353.420	26.676	0,80
4,250 % fällig am 10.12.2032		26.799.020	21.254	0,63
Spain Government International Bond				
1,000 % fällig am 30.07.2042	€	3.200	2.202	0,07
1,450 % fällig am 31.10.2071		500	265	0,01
3,450 % fällig am 30.07.2066		9.600	9.551	0,29
Svensk Exportkredit AB				
2,000 % fällig am 30.06.2027		5.500	5.676	0,17
Tokyo Metropolitan Government				
2,625 % fällig am 29.05.2024	$	400	388	0,01
United Kingdom Gilt				
1,250 % fällig am 31.07.2051	£	7.100	4.479	0,13
1,500 % fällig am 31.07.2053		7.500	4.980	0,15
			551.504	16,49
KURZFRISTIGE INSTRUMENTE				
COMMERCIAL PAPER				
AT+T, Inc.				
5,700 % fällig am 19.03.2024	$	12.700	12.158	0,36
Global Payments, Inc.				
5,930 % fällig am 28.07.2023		2.600	2.588	0,08
Quanta Services, Inc.				
5,900 % fällig am 07.07.2023		5.500	5.494	0,16
5,900 % fällig am 10.07.2023		700	699	0,02
5,900 % fällig am 11.07.2023		900	899	0,03
5,900 % fällig am 12.07.2023		900	898	0,03
5,900 % fällig am 13.07.2023		900	898	0,03
			23.634	0,71

BESCHREIBUNG		PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
HUNGARY TREASURY BILLS				
16,220 % fällig am 06.07.2023 (a)(b)	HUF	2.947.000	$ 8.602	0,26
ISRAEL TREASURY BILLS				
1,755 % fällig am 05.07.2023 (a)(b)	ILS	25.100	6.759	0,20
JAPAN TREASURY BILLS				
(0,211) % fällig am 24.07.2023 (a)(b)	¥	6.894.000	47.701	1,43
(0,202) % fällig am 18.07.2023 (a)(b)		8.800.000	60.888	1,82
(0,202) % fällig am 28.08.2023 (a)(b)		9.848.000	68.149	2,04
(0,200) % fällig am 28.08.2023 (a)(b)		2.072.000	14.339	0,43
(0,199) % fällig am 11.09.2023 (a)(b)		2.256.000	15.613	0,47
(0,197) % fällig am 31.07.2023 (a)(b)		3.420.000	23.664	0,71
(0,196) % fällig am 14.08.2023 (a)(b)		8.170.000	56.535	1,69
(0,187) % fällig am 10.07.2023 (a)(b)		8.000.000	55.351	1,65
(0,186) % fällig am 07.08.2023 (a)(b)		2.093.000	14.483	0,43
(0,183) % fällig am 21.08.2023 (a)(b)		20.330.000	140.682	4,21
(0,182) % fällig am 24.07.2023 (a)(b)		10.336.000	71.517	2,14
(0,179) % fällig am 11.09.2023 (a)(b)		504.000	3.488	0,10
(0,178) % fällig am 31.07.2023 (a)(b)		970.000	6.712	0,20
(0,173) % fällig am 19.09.2023 (a)(b)		180.000	1.246	0,04
(0,172) % fällig am 19.09.2023 (a)(b)		3.940.000	27.267	0,81
(0,168) % fällig am 10.07.2023 (a)(b)		3.610.000	24.977	0,75
(0,166) % fällig am 07.08.2023 (a)(b)		797.000	5.515	0,16
(0,152) % fällig am 25.09.2023 (a)(b)		4.314.000	29.856	0,89
(0,132) % fällig am 25.09.2023 (a)(b)		1.226.000	8.485	0,25
			676.468	20,22
Summe kurzfristige Instrumente			715.463	21,39
Summe Übertragbare Wertpapiere			**$ 3.663.093**	**109,51**

PENSIONSGESCHÄFTE

Kontrahent	Kredit-zins	Abrechnungs-datum	Fälligkeits-datum	Kapital-betrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensions-geschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensions-geschäft[1]	% des Nettovermögens
BPS	5,100 %	30.06.2023	03.07.2023	$ 100	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.01.2030	$ (102)	$ 100	$ 100	0,00
	5,120	30.06.2023	03.07.2023	178.000	U.S. Treasury Notes 1,250 % fällig am 31.05.2028	(181.598)	178.000	178.076	5,33
	5,160	30.06.2023	03.07.2023	26.400	U.S. Treasury Notes 2,000 % fällig am 15.08.2025	(26.963)	26.400	26.411	0,79
FICC	2,400	30.06.2023	03.07.2023	1.785	U.S. Treasury Notes 4,625 % fällig am 30.06.2025	(1.821)	1.785	1.785	0,05
Summe Pensionsgeschäfte						**$ (210.484)**	**$ 206.285**	**$ 206.372**	**6,17**

[1] Umfasst aufgelaufene Zinsen.

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

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

FUTURES

Beschreibung	Art	Ablauf-monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
3-Month SOFR December Futures	Short	03.2024	741	$ 1.986	0,06
3-Month SOFR June Futures	Short	09.2024	329	117	0,00
3-Month SOFR March Futures	Long	06.2024	329	(74)	0,00
Australia Government 3-Year Note September Futures	Short	09.2023	73	29	0,00
Australia Government 10-Year Bond September Futures	Short	09.2023	128	53	0,00
Canada Government 10-Year Bond September Futures	Short	09.2023	21	33	0,00
Euro-Bobl September Futures	Short	09.2023	1.978	3.651	0,11
Euro-BTP Italy Government Bond September Futures	Short	09.2023	759	842	0,03
Euro-BTP Italy Government Bond September Futures	Short	09.2023	205	(225)	(0,01)
Euro-Bund 10-Year Bond September Futures	Short	09.2023	312	417	0,01
Euro-Buxl 30-Year Bond September Futures	Short	09.2023	15	(33)	0,00
Euro-OAT France Government 10-Year Bond September Futures	Short	09.2023	325	358	0,01
Euro-Schatz September Futures	Short	09.2023	1.677	393	0,01
Japan Government 10-Year Bond September Futures	Short	09.2023	15	(54)	0,00
U.S. Treasury 5-Year Note September Futures	Long	09.2023	206	(442)	(0,01)
U.S. Treasury 10-Year Note September Futures	Long	09.2023	542	(834)	(0,02)
U.S. Treasury 10-Year Ultra September Futures	Short	09.2023	166	190	0,01
U.S. Treasury 30-Year Bond September Futures	Long	09.2023	20	(1)	0,00
U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond September Futures	Long	09.2023	221	362	0,01
United Kingdom Long Gilt September Futures	Short	09.2023	320	148	0,00
				$ 6.916	0,21

VERKAUFSOPTIONEN

Beschreibung	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Anzahl der Kontrakte	Aufgeld	Markt-wert	% des Nettovermögens
Put - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note August Futures	$ 111,500	21.07.2023	76	$ (33)	$ (29)	0,00
Call - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note August Futures	115,500	21.07.2023	76	(27)	(4)	0,00
Call - CME-Kaufoptionen mit Ausübungskurs bei 98,000 USD auf 3-Month SOFR December Futures	98,000	15.12.2023	47	0	(2)	0,00
Put - CME-Verkaufsoptionen mit Ausübungskurs bei 96,500 USD auf 3-Month SOFR December Futures	96,500	15.12.2023	47	0	(221)	(0,01)
				$ (60)	$ (256)	(0,01)

Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate	**$ 6.660**	**0,20**

ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)

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

ZINSSWAPS

Zahlung/ Erhalt variabel Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fest-Zinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Zahlung[1]	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	3,250 %	20.09.2053	£ 15.400	$ (1.392)	(0,04)
Zahlung[1]	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	3,500	20.09.2033	195.100	(10.205)	(0,30)
Zahlung[1]	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	3,750	20.09.2028	22.400	(1.429)	(0,04)
Erhalt[1]	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	4,000	20.09.2025	29.900	1.100	0,03
Erhalt	1-Day INR-MIBOR Compounded-OIS	6,250	16.03.2032	INR 316.000	(248)	(0,01)
Zahlung	1-Day INR-MIBOR Compounded-OIS	6,500	15.03.2028	496.310	49	0,00
Zahlung	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,000	15.12.2028	¥ 180.000	(4)	0,00
Zahlung	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,000	17.03.2031	1.500.000	(74)	0,00
Zahlung	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,035	29.11.2029	1.500.000	(57)	0,00
Zahlung	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,050	15.12.2031	3.010.000	(120)	0,00
Zahlung	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,200	19.06.2029	1.060.000	(49)	0,00
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,400	19.06.2039	430.000	84	0,00
Zahlung	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,450	15.12.2051	890.000	252	0,01
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,800	15.06.2052	360.000	71	0,00
Zahlung	1-Day SGD-SIBCSORA Compounded-OIS	3,000	15.03.2028	SGD 14.440	(274)	(0,01)
Erhalt	1-Day USD-Federal Funds Rate Compounded-OIS	2,684	30.04.2025	$ 900	29	0,00
Erhalt	1-Day USD-Federal Funds Rate Compounded-OIS	2,696	30.04.2025	900	29	0,00
Erhalt	1-Day USD-Federal Funds Rate Compounded-OIS	2,710	30.04.2025	1.000	32	0,00
Erhalt	1-Day USD-Federal Funds Rate Compounded-OIS	2,714	30.04.2025	1.900	61	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	0,250	15.12.2023	28.500	(196)	(0,01)
Zahlung[1]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	0,500	15.12.2023	39.400	1.109	0,03
Zahlung[1]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	0,500	16.06.2028	5.300	(120)	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,430	31.03.2024	33.000	(266)	(0,01)
Zahlung[1]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,500	15.12.2028	20.200	(759)	(0,02)

Zahlung/ Erhalt variabel Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fest-Zinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,500 %	15.06.2052	$ 13.400	$ (1.611)	(0,05)
Zahlung[1]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,518	20.01.2029	12.300	(546)	(0,02)
Zahlung[1]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,545	20.01.2029	8.200	(366)	(0,01)
Zahlung[1]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,630	20.01.2029	10.300	(469)	(0,01)
Zahlung[1]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,630	26.01.2029	2.300	(103)	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,695	15.11.2031	42.700	(3.613)	(0,11)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,750	15.06.2024	139.200	1.760	0,05
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,750	15.06.2027	1.120	(15)	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,750	15.12.2051	3.000	(412)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,750	15.06.2052	27.180	148	0,00
Zahlung[1]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,000	15.12.2051	26.100	(2.952)	(0,09)
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,750	21.06.2053	4.050	(4)	0,00
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,817	30.04.2029	18.420	1.240	0,04
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,819	30.04.2029	12.600	848	0,03
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,965	30.11.2026	122.300	6.869	0,21
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,000	21.06.2033	20.570	297	0,01
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,048	15.11.2032	8.100	380	0,01
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,050	08.09.2029	14.000	(604)	(0,02)
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,070	15.11.2032	15.100	675	0,02
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,080	23.02.2053	9.600	(176)	(0,01)
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,089	15.11.2032	100	4	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,100	09.09.2029	2.400	(96)	0,00
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,104	15.11.2032	9.190	385	0,01
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,106	15.11.2032	14.500	605	0,02
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,139	15.11.2032	19.600	765	0,02
Erhalt[1]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,150	13.05.2025	361.700	3.529	0,11
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,163	30.09.2029	6.800	(256)	(0,01)
Zahlung[1]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,165	03.10.2053	4.400	14	0,00
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,173	15.11.2032	24.700	905	0,03
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,174	15.11.2032	13.400	485	0,01
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,178	31.08.2027	44.100	(1.380)	(0,04)
Erhalt[1]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,200	13.05.2025	22.500	255	0,01
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,224	30.06.2024	7.091	133	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,225	30.09.2029	800	(30)	0,00
Zahlung[1]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,240	03.10.2053	4.400	75	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,250	21.06.2028	5.800	(200)	(0,01)
Zahlung[1]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,250	20.12.2053	14.100	(51)	0,00
Erhalt[1]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,445	03.10.2038	14.300	5	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,454	30.06.2029	17.400	(308)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,470	22.02.2030	4.900	(82)	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,500	22.06.2030	4.400	(39)	0,00

Zahlung/ Erhalt variabel Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fest-Zinssatz	Fälligkeits-datum		Nenn-betrag		Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Erhalt[1]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,500 %	20.12.2030	$	400	$	4	0,00
Erhalt[1]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,500	20.12.2033		23.835		194	0,01
Zahlung[1]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,522	30.11.2027		19.640		(316)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,525	02.03.2030		700		(10)	0,00
Erhalt[1]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,533	03.10.2038		14.300		(139)	0,00
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,750	21.06.2025		38.900		739	0,02
Erhalt[1]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,750	20.12.2028		38.028		328	0,01
Zahlung[1]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,752	03.10.2028		18.400		(29)	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,800	10.03.2028		5.800		(48)	0,00
Zahlung[1]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,850	03.10.2028		18.400		51	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,898	30.06.2029		15.600		90	0,00
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	4,159	31.03.2025		34.000		569	0,02
Erhalt[1]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	4,250	20.12.2025		234.353		1.237	0,04
Erhalt[1]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	4,409	04.10.2024		13.400		(171)	0,00
Erhalt[1]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	4,409	04.10.2024		13.400		175	0,00
Erhalt[1]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	4,427	27.09.2024		14.200		(172)	0,00
Erhalt[1]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	4,427	27.09.2024		14.200		145	0,00
Erhalt[1]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	4,433	06.09.2024		46.500		(707)	(0,02)
Erhalt[1]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	4,433	06.09.2024		46.500		486	0,00
Erhalt[1]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	4,789	07.03.2024		6.300		(50)	0,00
Erhalt[1]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	4,789	07.03.2024		6.300		28	0,00
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	1,000	16.06.2026	CAD	20.500		(257)	(0,01)
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	1,250	16.06.2031		19.300		(325)	(0,01)
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	1,500	17.06.2025		600		(4)	0,00
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	1,500	17.06.2030		27.900		(386)	(0,01)
Erhalt	3-Month CAD-Bank Bill	3,250	15.03.2028		15.410		554	0,02
Zahlung[1]	3-Month CAD-CAONREPO Compounded-OIS	3,250	20.12.2028		24.600		6	0,00
Zahlung	3-Month CAD-CAONREPO Compounded-OIS	3,250	21.06.2033		46.200		199	0,01
Erhalt	3-Month CAD-CAONREPO Compounded-OIS	3,250	21.06.2053		3.900		4	0,00
Zahlung[1]	3-Month CAD-CAONREPO Compounded-OIS	3,500	10.05.2025		498.400		(3.051)	(0,09)
Zahlung	3-Month CHF-SRFXON3 Compounded-OIS	0,283	14.02.2027	CHF	4.200		(179)	(0,01)
Zahlung	3-Month CHF-SRFXON3 Compounded-OIS	0,294	10.02.2027		15.500		(663)	(0,02)
Zahlung	3-Month CHF-SRFXON3 Compounded-OIS	0,343	16.05.2027		6.300		(263)	(0,01)
Zahlung	3-Month CNY-CNREPOFIX	2,500	16.03.2027	CNY	83.500		(9)	0,00
Zahlung	3-Month EUR-ESTRON Compounded-OIS	1,000	23.11.2024	€	67.800		(1.254)	(0,04)
Zahlung	3-Month KRW-KORIBOR	3,250	15.03.2028	KRW	206.689.988		(2.972)	(0,09)
Erhalt	3-Month KRW-KORIBOR	3,250	15.03.2033		19.094.564		20	0,00
Erhalt[1]	3-Month KRW-KORIBOR	3,250	20.09.2033		23.690.080		51	0,00
Zahlung	3-Month NZD-BBR	0,528	17.03.2024	NZD	950		10	0,00
Zahlung	3-Month NZD-BBR	3,000	15.12.2023		53.500		(109)	0,00
Zahlung	3-Month NZD-BBR	3,750	15.06.2027		35.300		(1.072)	(0,03)
Zahlung	3-Month NZD-BBR	4,000	14.06.2024		93.500		(1.062)	(0,03)
Zahlung[1]	3-Month NZD-BBR	5,000	20.03.2025		54.500		(91)	0,00
Zahlung	3-Month SEK-STIBOR	1,000	19.06.2029	SEK	11.700		(37)	0,00
Erhalt	3-Month THB-THORON Compounded-OIS	2,250	15.03.2028	THB	1.080.630		365	0,01
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	0,500	15.09.2023	$	39.400		(510)	(0,02)
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	0,500	16.09.2023		5.300		(69)	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,500	15.09.2023		20.200		(211)	(0,01)
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,518	20.07.2023		12.300		(71)	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,545	20.07.2023		8.200		(46)	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,630	20.07.2023		10.300		(54)	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,630	26.07.2023		2.300		(12)	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	2,000	15.09.2023		26.100		(240)	(0,01)
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	4,409	04.07.2023		13.400		29	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	4,409	04.07.2023		13.400		(29)	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	4,427	27.07.2023		14.200		(10)	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	4,427	27.09.2023		14.200		44	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	4,433	06.07.2023		46.500		(81)	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	4,433	06.09.2023		46.500		138	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	4,789	07.07.2023		6.300		(3)	0,00

Zahlung/ Erhalt variabel Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fest-Zinssatz	Fälligkeits-datum		Nenn-betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	4,789 %	07.09.2023	$	6.300	$ 13	0,00
Erhalt	6-Month AUD-BBR-BBSW	1,250	17.06.2030	AUD	4.800	33	0,00
Zahlung	6-Month AUD-BBR-BBSW	1,750	16.03.2027		3.000	(28)	0,00
Erhalt	6-Month AUD-BBR-BBSW	1,750	16.06.2031		6.450	87	0,00
Zahlung	6-Month AUD-BBR-BBSW	4,000	21.06.2033		37.200	(977)	(0,03)
Zahlung[1]	6-Month AUD-BBR-BBSW	4,250	15.09.2032		5.700	(25)	0,00
Zahlung	6-Month AUD-BBR-BBSW	4,250	15.03.2033		40.300	(916)	(0,03)
Zahlung[1]	6-Month AUD-BBR-BBSW	4,500	15.09.2032		207.770	321	0,01
Zahlung	6-Month CZK-PRIBOR	1,913	30.01.2029	CZK	7.400	(5)	0,00
Erhalt[1]	6-Month EUR-EURIBOR	0,054	27.05.2050	€	600	71	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	0,064	17.11.2052		1.300	219	0,01
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	0,250	15.09.2036		1.400	(161)	0,00
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	0,650	12.04.2027		6.000	(443)	(0,01)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	0,650	11.05.2027		4.300	(316)	(0,01)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	0,700	11.04.2027		3.300	(245)	(0,01)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	1,000	30.03.2024		130.139	(3.107)	(0,09)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	1,000	13.05.2027		7.200	(547)	(0,02)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	1,000	18.05.2027		3.500	(266)	(0,01)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,100	11.04.2024		18.200	(285)	(0,01)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,100	13.04.2024		41.200	(644)	(0,02)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,100	17.05.2024		9.300	(157)	0,00
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,250	26.04.2024		5.800	(81)	0,00
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,250	28.04.2024		6.800	(101)	0,00
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,250	03.05.2024		6.400	(96)	0,00
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,250	21.09.2037		11.890	(635)	(0,02)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,250	21.09.2042		6.060	(963)	(0,03)
Erhalt[1]	6-Month EUR-EURIBOR	2,500	20.09.2053		58.300	(587)	(0,02)
Zahlung[1]	6-Month EUR-EURIBOR	3,000	19.03.2027		136.070	(940)	(0,03)
Zahlung[1]	6-Month EUR-EURIBOR	3,000	20.09.2028		327.800	(1.086)	(0,03)
Erhalt[1]	6-Month EUR-EURIBOR	3,000	15.03.2033		58.910	(154)	0,00
Zahlung[1]	6-Month EUR-EURIBOR	3,000	20.09.2033		287.460	165	0,00
Zahlung[1]	6-Month EUR-EURIBOR	3,500	20.09.2025		47.000	30	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	4,870	07.07.2025	MXN	20.400	(9)	0,00
						$ (27.394)	(0,82)
Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate						**$ (27.394)**	**(0,82)**

[1] Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft.

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

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

OPTIONSKAUF

ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag[1]	Kosten	Markt-wert	% des Nettovermögens
BOA	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,180 %	11.01.2024	8.600	$ 246	$ 883	0,02

OPTIONEN AUF WERTPAPIERE

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag[1]	Kosten	Markt-wert	% des Nettovermögens
BPS	Put - OTC France Government International Bond 0,750 % fällig am 25.05.2052	€ 97,000	23.05.2025	2.200	$ 166	$ 917	0,03

VERKAUFSOPTIONEN

ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag[1]	Aufgeld	Markt-wert	% des Nettovermögens
BOA	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,150 %	01.12.2023	6.200	$ (19)	$ (1)	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,650	01.12.2023	6.200	(19)	(84)	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,310	11.01.2024	76.400	(247)	(1.849)	(0,06)
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,380	31.07.2023	4.500	(17)	(22)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,780	31.07.2023	4.500	(17)	(13)	0,00
	Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,070	10.07.2023	800	(5)	(2)	0,00
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,370	10.07.2023	800	(5)	(1)	0,00
BPS	Put - OTC 25-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	0,451	23.05.2025	2.200	(166)	(842)	(0,03)
	Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,000	03.07.2023	1.000	(7)	0	0,00
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,400	03.07.2023	1.000	(7)	0	0,00
BRC	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,260	26.07.2023	600	(2)	(1)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,660	26.07.2023	600	(2)	(3)	0,00
FAR	Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,000	03.07.2023	1.700	(12)	0	0,00
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,400	03.07.2023	1.700	(12)	0	0,00
	Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,100	31.08.2023	7.900	(58)	(11)	0,00
	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,800	31.08.2023	7.900	(58)	(80)	0,00

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag[1]	Aufgeld	Markt-wert	% des Nettovermögens
GLM	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,920 %	13.10.2023	5.600	$ (34)	$ (1)	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,920	13.10.2023	5.600	(34)	(120)	(0,01)
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,018	20.10.2023	2.500	(16)	0	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,018	20.10.2023	2.500	(16)	(51)	0,00
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,140	23.10.2023	2.500	(18)	0	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,140	23.10.2023	2.500	(18)	(48)	0,00
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,190	23.10.2023	2.500	(17)	0	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,190	23.10.2023	2.500	(17)	(47)	0,00
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,225	23.10.2023	2.600	(18)	(1)	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,225	23.10.2023	2.600	(18)	(48)	0,00
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,841	27.10.2023	3.000	(21)	0	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,841	27.10.2023	3.000	(21)	(65)	0,00
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,088	03.11.2023	5.400	(39)	(1)	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,088	03.11.2023	5.400	(39)	(104)	0,00
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,910	10.11.2023	3.000	(20)	(1)	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,910	10.11.2023	3.000	(20)	(62)	0,00
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,250	17.11.2023	5.100	(19)	(1)	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,750	17.11.2023	5.100	(19)	(66)	0,00
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,150	20.11.2023	4.600	(16)	0	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,650	20.11.2023	4.600	(16)	(64)	0,00
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,250	07.12.2023	5.200	(16)	(1)	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,750	07.12.2023	5.200	(16)	(65)	0,00
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,697	02.04.2024	9.300	(73)	(11)	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,697	02.04.2024	9.300	(73)	(171)	(0,01)
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,721	08.04.2024	2.800	(21)	(4)	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,721	08.04.2024	2.800	(21)	(50)	0,00
JPM	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	6-Month GBP-LIBOR	Erhalt	0,820	16.12.2024	20.100	(142)	(21)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,250	20.07.2023	800	(3)	(1)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,650	20.07.2023	800	(3)	(3)	0,00
MYC	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,993	11.10.2023	9.600	(65)	(2)	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,993	11.10.2023	9.600	(65)	(202)	(0,01)
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,270	24.07.2023	1.900	(6)	(3)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,670	24.07.2023	1.900	(6)	(8)	0,00
							$ (1.599)	$ (4.131)	(0,12)

(1) Der Nennbetrag stellt die Anzahl der Kontrakte dar.

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMMISSIONEN - SCHUTZVERKAUF[1]

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag[2]	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Markt-wert	% des Nettovermögens
BRC	Italy Government International Bond	1,000 %	20.06.2025	$ 1.700	$ (41)	$ 62	$ 21	0,00
CBK	Italy Government International Bond	1,000	20.06.2025	1.100	(27)	40	13	0,00
					$ (68)	$ 102	$ 34	0,00

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

(2) Der maximal mögliche Betrag, den der Fonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

CROSS-CURRENCY SWAPS

Kontrahent	Erhalt	Zahlung	Fälligkeits-datum	Nennbetrag erhaltener Währung	Nennbetrag gelieferter Währung	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Markt-wert	% des Nettovermögens
AZD	Variabler Zinssatz entspricht 3-Month AUD-LIBOR zzgl. 0,290 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung	Variabler Zinssatz entspricht 3-Month USD-LIBOR basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung	04.01.2031	AUD 14.600	$ 11.000	$ 72	$ (43)	$ 29	0,00
CBK	Variabler Zinssatz entspricht 3-Month AUD-LIBOR zzgl. 0,420 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung	Variabler Zinssatz entspricht 3-Month USD-LIBOR basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung	31.07.2029	5.100	3.519	(1)	8	7	0,00
GLM	Variabler Zinssatz entspricht 3-Month AUD-LIBOR zzgl. 0,423 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung	Variabler Zinssatz entspricht 3-Month USD-LIBOR basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung	01.08.2029	5.000	3.450	(9)	8	(1)	0,00
MYC	Variabler Zinssatz entspricht 3-Month AUD-LIBOR zzgl. 0,298 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung	Variabler Zinssatz entspricht 3-Month USD-LIBOR basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung	14.10.2030	10.100	7.256	44	(27)	17	0,00
						$ 106	$ (54)	$ 52	0,00

ZINSSWAPS

Kontrahent	Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Markt-wert	% des Nettovermögens
BOA	Erhalt	3-Month MYR-KLIBOR	3,500 %	15.03.2028	MYR 149.702	$ (57)	$ 280	$ 223	0,01
	Erhalt	3-Month MYR-KLIBOR	3,750	15.03.2033	40.320	(11)	102	91	0,00
BPS	Erhalt	3-Month MYR-KLIBOR	3,500	15.03.2028	94.570	(38)	179	141	0,01
GLM	Erhalt	3-Month MYR-KLIBOR	3,545	05.05.2028	47.895	0	56	56	0,00
	Erhalt	3-Month MYR-KLIBOR	3,635	05.04.2024	127.141	(29)	20	(9)	0,00
	Erhalt	3-Month MYR-KLIBOR	3,750	15.03.2033	20.558	43	3	46	0,00
GST	Erhalt	3-Month MYR-KLIBOR	3,500	15.03.2028	8.537	(3)	16	13	0,00
SCX	Erhalt	3-Month MYR-KLIBOR	3,750	15.03.2028	42.080	(127)	89	(38)	0,00
						$ (222)	$ 745	$ 523	0,02

DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung		Zu erhaltende Währung		Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
AZD	07.2023	AUD	3.320	$	2.203	$ 0	$ (7)	$ (7)	0,00
	07.2023	$	737	AUD	1.126	13	0	13	0,00
	08.2023		2.205		3.320	7	0	7	0,00
BOA	07.2023	AUD	8.500	$	5.766	108	0	108	0,00
	07.2023	CAD	50.383		37.028	0	(1.049)	(1.049)	(0,03)
	07.2023	DKK	35.412		5.114	0	(75)	(75)	0,00
	07.2023	MXN	71.776		3.899	0	(276)	(276)	(0,01)
	07.2023	NZD	5.349		3.245	0	(32)	(32)	0,00
	07.2023	$	3.862	AUD	5.924	81	0	81	0,00
	07.2023		2.290	CAD	3.050	15	0	15	0,00
	07.2023		20.627	DKK	140.246	0	(77)	(77)	0,00
	07.2023		1.217	€	1.114	0	(2)	(2)	0,00
	07.2023		1.127	£	886	0	0	0	0,00
	07.2023		19.499	NOK	214.349	508	0	508	0,02
	07.2023		413	PEN	1.516	5	0	5	0,00
	08.2023	CNY	1.769	$	258	13	0	13	0,00
	08.2023	DKK	140.012		20.627	78	0	78	0,00
	09.2023	CLP	2.908.781		3.559	0	(36)	(36)	0,00
	09.2023	¥	4.120.000		29.662	820	0	820	0,02
	09.2023	TWD	355.331		11.705	272	0	272	0,01
	09.2023	$	3.601	IDR	53.909.934	0	(20)	(20)	0,00
	09.2023		8.639	INR	714.528	47	0	47	0,00
	09.2023		3	KRW	3.485	0	0	0	0,00
	09.2023		1.647	PEN	6.043	10	0	10	0,00
BPS	07.2023	AUD	4.133	$	2.744	1	(8)	(7)	0,00
	07.2023	CAD	2.526		1.890	0	(19)	(19)	0,00
	07.2023	€	501.328		538.932	0	(8.018)	(8.018)	(0,24)
	07.2023	¥	1.249.547		8.994	349	0	349	0,01
	07.2023	MYR	5.445		1.186	17	0	17	0,00
	07.2023	NOK	47.367		4.406	0	(15)	(15)	0,00
	07.2023	SGD	1.453		1.091	17	0	17	0,00
	07.2023	$	4.086	AUD	6.238	66	0	66	0,00
	07.2023		56	BRL	274	0	0	0	0,00
	07.2023		420	CHF	375	0	0	0	0,00
	07.2023		554.006	€	505.576	6	(2.429)	(2.423)	(0,07)
	07.2023		4.185	£	3.266	0	(33)	(33)	0,00
	08.2023	BRL	274	$	56	0	0	0	0,00
	08.2023	CHF	374		420	0	0	0	0,00
	08.2023	CNH	47.871		6.872	267	0	267	0,01
	08.2023	CNY	2.080		304	16	0	16	0,00
	08.2023	€	486.024		533.285	2.306	0	2.306	0,07
	08.2023	TWD	177.855		5.825	114	0	114	0,00
	08.2023	$	1.573	AUD	2.373	8	0	8	0,00
	08.2023		1.028	CNH	7.105	0	(48)	(48)	0,00
	08.2023		4.406	NOK	47.320	16	0	16	0,00
	08.2023		1.108	TWD	33.746	0	(24)	(24)	0,00
	08.2023		54	ZAR	1.002	0	(1)	(1)	0,00
	09.2023	THB	20	$	1	0	0	0	0,00
	01.2024	DKK	79.126		11.744	13	0	13	0,00
	04.2024		86.673		12.926	8	0	8	0,00
BRC	07.2023	£	2.553		3.169	0	(77)	(77)	0,00
	07.2023	¥	8.800.000		68.037	7.033	0	7.033	0,21
	07.2023	MYR	1.117		243	4	0	4	0,00
	07.2023	NZD	126		76	0	(2)	(2)	0,00
	07.2023	$	7.779	£	6.226	137	0	137	0,00
	08.2023		477	CNH	3.307	0	(21)	(21)	0,00
	08.2023		66	ZAR	1.212	0	(2)	(2)	0,00
	09.2023	IDR	182.184	$	12	0	0	0	0,00
	09.2023	ILS	2.726		762	25	0	25	0,00
	09.2023	$	456	PEN	1.669	2	0	2	0,00
	04.2024	DKK	204.732	$	30.585	73	0	73	0,00
	04.2024	¥	1.690.042		13.839	1.621	0	1.621	0,05
	05.2024		1.370.000		11.081	1.132	0	1.132	0,03
BSH	07.2023	$	1.370	PEN	5.041	21	0	21	0,00

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung		Zu erhaltende Währung		Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
CBK	07.2023	AUD	3.842	$	2.634	$ 76	$ 0	$ 76	0,00
	07.2023	DKK	269.194		38.669	0	(774)	(774)	(0,02)
	07.2023	£	6.724		8.436	0	(113)	(113)	0,00
	07.2023	ILS	24.718		7.716	1.055	0	1.055	0,03
	07.2023	NZD	4.317		2.648	3	0	3	0,00
	07.2023	PEN	5.041		1.384	0	(6)	(6)	0,00
	07.2023	$	1.270	AUD	1.947	26	0	26	0,00
	07.2023		7.767	€	7.189	81	(5)	76	0,00
	07.2023		2.896	£	2.279	1	0	1	0,00
	07.2023		830	NOK	9.334	41	0	41	0,00
	07.2023		1.877	PEN	6.875	18	0	18	0,00
	08.2023	¥	7.743.821	$	56.187	2.165	0	2.165	0,06
	08.2023	PEN	6.056		1.550	0	(115)	(115)	0,00
	08.2023	TWD	185.168		6.066	119	0	119	0,00
	08.2023	$	2.620	CLP	2.170.650	76	0	76	0,00
	08.2023		1.381	PEN	5.041	6	0	6	0,00
	09.2023	CNH	66.947	$	9.395	135	0	135	0,00
	09.2023	KRW	68.029.122		52.906	1.058	0	1.058	0,03
	09.2023	$	2.764	THB	95.153	0	(60)	(60)	0,00
	10.2023		14	CLP	11.090	0	0	0	0,00
	11.2023	ILS	63.106	$	18.857	1.739	0	1.739	0,05
FAR	07.2023	$	786	CLP	624.125	0	(9)	(9)	0,00
GLM	07.2023	BRL	86.425	$	17.899	0	(17)	(17)	0,00
	07.2023	NOK	292.134		27.103	0	(165)	(165)	0,00
	07.2023	$	15.994	BRL	86.151	1.864	0	1.864	0,06
	08.2023	CNH	66.533	$	9.532	352	0	352	0,01
	08.2023	$	27.103	NOK	291.846	165	0	165	0,01
	09.2023	TWD	275.377	$	9.048	188	0	188	0,01
	09.2023	$	17.899	BRL	87.382	14	0	14	0,00
	09.2023		16.105	SGD	21.536	0	(146)	(146)	0,00
	09.2023		5.321	THB	183.133	0	(117)	(117)	0,00
JPM	07.2023	SGD	5.876	$	4.448	104	0	104	0,00
	07.2023	$	2.833	AUD	4.333	51	0	51	0,00
	07.2023		1.071	CAD	1.421	3	0	3	0,00
	07.2023		3.366	¥	481.344	0	(35)	(35)	0,00
	07.2023		272	SGD	359	0	(6)	(6)	0,00
	08.2023	CNH	29.416	$	4.126	69	0	69	0,00
	08.2023	CNY	2.194		321	17	0	17	0,00
	08.2023	¥	4.655.478		33.642	1.178	0	1.178	0,04
	08.2023	$	825	CNH	5.703	0	(39)	(39)	0,00
	08.2023		506	HUF	174.852	1	(2)	(1)	0,00
	09.2023	IDR	9.170	$	1	0	0	0	0,00
	09.2023	ILS	2.616		736	30	0	30	0,00
	09.2023	KRW	25.286.558		19.528	256	0	256	0,01
	09.2023	PEN	26.331		7.151	0	(69)	(69)	0,00
	09.2023	$	1.499	IDR	22.550.990	0	(1)	(1)	0,00
	09.2023		14	KRW	18.517	0	0	0	0,00
	09.2023		1.656	SGD	2.215	0	(15)	(15)	0,00
	09.2023		3.353	THB	114.991	0	(86)	(86)	0,00
	10.2023		221	MXN	3.875	1	0	1	0,00
	12.2023		15.647	INR	1.291.210	0	(6)	(6)	0,00
	10.2024	¥	4.060.000	$	32.677	2.563	0	2.563	0,08
MBC	07.2023	AUD	2.337		1.542	0	(14)	(14)	0,00
	07.2023	€	17.442		18.868	16	(177)	(161)	0,00
	07.2023	£	85.166		105.917	88	(2.449)	(2.361)	(0,07)
	07.2023	¥	17.230.000		131.929	12.378	0	12.378	0,37
	07.2023	SGD	394		293	2	0	2	0,00
	07.2023	$	30.705	CAD	40.857	193	(22)	171	0,01
	07.2023		3.763	€	3.516	73	0	73	0,00
	07.2023		5.867	£	4.708	118	0	118	0,00
	08.2023	CNH	128.902	$	18.114	336	0	336	0,01
	08.2023	¥	20.330.000		148.815	7.145	0	7.145	0,21
	09.2023		2.760.000		20.105	808	0	808	0,02
	09.2023	$	5	KRW	6.461	0	0	0	0,00
	10.2023	DKK	178.828	$	26.437	90	0	90	0,00
	03.2024	¥	4.110.103		33.566	4.001	0	4.001	0,12
	10.2024		2.760.000		22.134	1.663	0	1.663	0,05
MYI	07.2023	CHF	164		184	1	0	1	0,00
	07.2023	€	7.808		8.511	0	(7)	(7)	0,00
	07.2023	£	2.650		3.296	0	(73)	(73)	0,00
	07.2023	IDR	14.211.310		950	2	0	2	0,00
	07.2023	MYR	372		81	1	0	1	0,00
	07.2023	NZD	355		215	0	(3)	(3)	0,00
	07.2023	$	3.265	AUD	4.877	0	(18)	(18)	0,00
	07.2023		10	CHF	9	0	0	0	0,00
	07.2023		18.336	DKK	125.075	0	(9)	(9)	0,00
	07.2023		3.513	£	2.771	13	(3)	10	0,00
	07.2023		946	IDR	14.211.310	2	0	2	0,00
	08.2023	DKK	124.866	$	18.336	10	0	10	0,00
	08.2023	TWD	192.093		6.334	165	0	165	0,00
	09.2023	$	4.703	IDR	70.272.753	0	(35)	(35)	0,00
	09.2023		1.531	THB	52.416	0	(41)	(41)	0,00

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung		Zu erhaltende Währung		Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
	04.2024	DKK	86.200	$	12.983	$ 136	$ 0	$ 136	0,00
RBC	07.2023	$	1.307	CAD	1.718	0	(8)	(8)	0,00
	08.2023		24	MXN	412	0	0	0	0,00
RYL	07.2023	NOK	20.615	$	1.938	14	0	14	0,00
	04.2024	DKK	55.000		8.260	63	0	63	0,00
SCX	07.2023	AUD	4.877		3.237	0	(9)	(9)	0,00
	07.2023	CHF	230		256	0	(1)	(1)	0,00
	07.2023	MYR	5.445		1.185	16	0	16	0,00
	07.2023	NZD	13.931		8.459	0	(76)	(76)	0,00
	07.2023	$	3.997	AUD	6.116	75	0	75	0,00
	07.2023		2.773	CAD	3.767	73	0	73	0,00
	07.2023		151	£	120	1	0	1	0,00
	08.2023	CNH	39	$	5	0	0	0	0,00
	08.2023	CNY	5.826		853	47	0	47	0,00
	08.2023	$	3.240	AUD	4.877	9	0	9	0,00
	08.2023		393	CNH	2.703	0	(20)	(20)	0,00
	09.2023	CNH	23.105	$	3.238	42	0	42	0,00
	09.2023	IDR	9.080.446		611	8	0	8	0,00
	09.2023	TWD	296.912		9.739	186	0	186	0,01
	09.2023	$	4.547	IDR	68.245.498	0	(14)	(14)	0,00
	09.2023		862	PEN	3.174	9	0	9	0,00
	09.2023		7.994	THB	275.894	0	(154)	(154)	0,00
SSB	07.2023	CLP	625.020	$	778	0	0	0	0,00
	07.2023	¥	4.390.000		33.289	2.797	0	2.797	0,08
	08.2023		8.170.000		61.547	4.678	0	4.678	0,14
	08.2023	$	778	CLP	626.825	0	0	0	0,00
TOR	07.2023	AUD	6.001	$	3.964	0	(31)	(31)	0,00
	07.2023	¥	163.900		1.173	39	0	39	0,00
	07.2023	$	2.574	AUD	3.935	46	0	46	0,00
	07.2023		2.658	CAD	3.518	2	(2)	0	0,00
	07.2023		100.015	£	78.708	51	0	51	0,00
	07.2023		6.472	¥	932.039	0	(24)	(24)	0,00
	07.2023		14.664	NZD	24.079	88	0	88	0,00
	08.2023	CAD	3.516	$	2.658	2	(2)	0	0,00
	08.2023	£	78.708		100.037	0	(49)	(49)	0,00
	08.2023	¥	928.086		6.472	24	0	24	0,00
	08.2023	NZD	24.079		14.663	0	(88)	(88)	0,00
	08.2023	$	3.967	AUD	6.001	31	0	31	0,00
	08.2023		43	HUF	15.108	1	0	1	0,00
	09.2023	¥	5.540.000	$	39.318	498	0	498	0,02
UAG	07.2023	AUD	9.565		6.387	33	(13)	20	0,00
	07.2023	¥	11.610.000		88.565	8.180	0	8.180	0,24
	07.2023	$	6.529	AUD	9.671	10	(102)	(92)	0,00
	07.2023		13.550	NOK	149.935	445	0	445	0,01
	08.2023	¥	2.890.000	$	21.321	1.227	0	1.227	0,04
	08.2023	$	6.392	AUD	9.565	13	(33)	(20)	0,00
	09.2023	CNH	22.152	THB	107.282	0	(15)	(15)	0,00
	09.2023	ILS	2.264	$	632	21	0	21	0,00
	09.2023	SGD	16.778		12.554	121	0	121	0,00
	09.2023	$	8.177	INR	675.966	40	0	40	0,00
						$ 74.815	$ (17.549)	$ 57.266	1,71

ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklasse Class Z AUD (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung		Zu erhaltende Währung		Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
AZD	07.2023	AUD	21.400	$	14.201	$ 0	$ (44)	$ (44)	0,00
	07.2023	$	27.340	AUD	41.777	468	0	468	0,01
	08.2023		14.212		21.400	44	0	44	0,00
BOA	07.2023		83.801		128.959	2.044	(3)	2.041	0,06
BPS	07.2023	AUD	111.692	$	73.962	0	(386)	(386)	(0,01)
	07.2023	$	573	AUD	856	2	(5)	(3)	0,00
	08.2023		72.713		109.690	361	0	361	0,01
CBK	07.2023		18.100		27.689	352	(20)	332	0,01
JPM	07.2023		26.415		40.404	480	0	480	0,01
MYI	07.2023		283		423	0	(2)	(2)	0,00
RBC	07.2023		1.202		1.811	16	(13)	3	0,00
SCX	07.2023	AUD	37.749	$	25.059	0	(68)	(68)	0,00
	07.2023	$	21.031	AUD	32.184	393	0	393	0,01
	08.2023		25.079		37.749	68	0	68	0,00
TOR	07.2023	AUD	65.910	$	43.534	0	(339)	(339)	(0,01)
	07.2023	$	44.551	AUD	68.116	790	0	790	0,02
	08.2023		43.569		65.910	339	0	339	0,01
UAG	07.2023	AUD	136.580	$	90.811	270	(373)	(103)	0,00
	07.2023	$	32.533	AUD	49.695	547	0	547	0,02
	08.2023		84.539		127.220	373	(161)	212	0,01
						$ 6.547	$ (1.414)	$ 5.133	0,15

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklassen Institutional CHF (Hedged) thesaurierend und Class E CHF (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung		Zu erhaltende Währung		Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2023	$	1.498	CHF	1.341	$ 1	$ 0	$ 1	0,00
BPS	07.2023	CHF	186.865	$	208.940	70	0	70	0,00
	07.2023	$	270.701	CHF	244.893	3.029	0	3.029	0,09
	08.2023		208.940		186.334	0	(71)	(71)	0,00
MBC	07.2023		3.086		2.776	16	0	16	0,00
MYI	07.2023	CHF	2.562	$	2.830	0	(33)	(33)	0,00
	07.2023	$	2.190	CHF	1.977	20	0	20	0,00
RBC	07.2023		301		269	0	(1)	(1)	0,00
RYL	07.2023		390		351	2	0	2	0,00
SCX	07.2023		198.215		178.112	871	0	871	0,03
UAG	07.2023	CHF	193.036	$	215.342	0	(425)	(425)	(0,01)
	07.2023	$	179.536	CHF	161.317	777	0	777	0,02
	08.2023		215.342		192.486	424	0	424	0,01
						$ 5.210	$ (530)	$ 4.680	0,14

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklassen Institutional EUR (Currency Exposure) thesaurierend und Institutional GBP (Currency Exposure) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung		Zu erhaltende Währung		Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2023	CLP	548	$	1	$ 0	$ 0	$ 0	0,00
	07.2023	DKK	5		1	0	0	0	0,00
	07.2023	HUF	313		1	0	0	0	0,00
	07.2023	PEN	2		0	0	0	0	0,00
	07.2023	PLN	6		1	0	0	0	0,00
	07.2023	SEK	31		3	0	0	0	0,00
	07.2023	$	7	AUD	11	0	0	0	0,00
	07.2023		23	CAD	31	1	0	1	0,00
	07.2023		0	CHF	0	0	0	0	0,00
	07.2023		1	CLP	548	0	0	0	0,00
	07.2023		1	CNY	4	0	0	0	0,00
	07.2023		1	COP	2.479	0	0	0	0,00
	07.2023		1	DKK	10	0	0	0	0,00
	07.2023		178	€	166	3	0	3	0,00
	07.2023		97	¥	13.439	0	(4)	(4)	0,00
	07.2023		0	KRW	241	0	0	0	0,00
	07.2023		0	NOK	3	0	0	0	0,00
	07.2023		1	NZD	2	0	0	0	0,00
	07.2023		1	PEN	5	0	0	0	0,00
	07.2023		0	SEK	0	0	0	0	0,00
	07.2023		4	THB	128	0	0	0	0,00
	08.2023	THB	128	$	4	0	0	0	0,00
	08.2023	$	1	CLP	548	0	0	0	0,00
	08.2023		1	DKK	5	0	0	0	0,00
	08.2023		1	HUF	316	0	0	0	0,00
	08.2023		0	PEN	2	0	0	0	0,00
	08.2023		1	PLN	6	0	0	0	0,00
	08.2023		3	SEK	31	0	0	0	0,00
CBK	07.2023	€	166	$	180	0	(1)	(1)	0,00
	07.2023	MXN	47		3	0	0	0	0,00
	07.2023	$	2	AUD	3	0	0	0	0,00
	07.2023		2	CNY	14	0	0	0	0,00
	07.2023		0	COP	419	0	0	0	0,00
	07.2023		0	DKK	0	0	0	0	0,00
	07.2023		32	£	25	1	0	1	0,00
	07.2023		0	¥	21	0	0	0	0,00
	07.2023		3	MXN	47	0	0	0	0,00
	07.2023		0	NOK	0	0	0	0	0,00
	07.2023		0	NZD	0	0	0	0	0,00
	07.2023		3	SEK	30	0	0	0	0,00
	08.2023		181	€	166	1	0	1	0,00
	08.2023		3	MXN	47	0	0	0	0,00
GLM	07.2023	COP	2.898	$	1	0	0	0	0,00
	07.2023	IDR	80		0	0	0	0	0,00
	07.2023	MYR	14		3	0	0	0	0,00
	07.2023	NOK	5		0	0	0	0	0,00
	07.2023	PEN	3		1	0	0	0	0,00
	07.2023	THB	128		4	0	0	0	0,00
	07.2023	$	1	CHF	1	0	0	0	0,00
	07.2023		1	¥	112	0	0	0	0,00
	07.2023		3	MYR	14	0	0	0	0,00
	07.2023		1	PLN	6	0	0	0	0,00
	07.2023		0	RON	2	0	0	0	0,00
	07.2023		0	SGD	0	0	0	0	0,00
	08.2023		1	COP	2.898	0	0	0	0,00
	08.2023		3	MYR	14	0	0	0	0,00
	08.2023		0	NOK	5	0	0	0	0,00
UAG	07.2023	AUD	18	$	12	0	0	0	0,00

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
	07.2023	CHF 4	$ 4	$ 0	$ 0	$ 0	0,00
	07.2023	ILS 4	1	0	0	0	0,00
	07.2023	$ 3	AUD 4	0	0	0	0,00
	07.2023	0	CAD 0	0	0	0	0,00
	07.2023	3	CHF 3	0	0	0	0,00
	07.2023	73	CNY 512	0	(2)	(2)	0,00
	07.2023	1	CZK 26	0	0	0	0,00
	07.2023	1	HUF 313	0	0	0	0,00
	07.2023	4	IDR 56.540	0	0	0	0,00
	07.2023	1	ILS 4	0	0	0	0,00
	07.2023	9	KRW 11.944	0	0	0	0,00
	07.2023	0	NOK 3	0	0	0	0,00
	07.2023	0	RON 0	0	0	0	0,00
	07.2023	2	SGD 2	0	0	0	0,00
	08.2023	12	AUD 18	0	0	0	0,00
	08.2023	4	CHF 4	0	0	0	0,00
	08.2023	1	ILS 4	0	0	0	0,00
				$ 6	$ (7)	$ (1)	0,00

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklassen Institutional EUR (Hedged) thesaurierend, Institutional EUR (Hedged) ausschüttend und Class E EUR (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2023	€ 1.003	$ 1.092	$ 1	$ (3)	$ (2)	0,00
	07.2023	$ 362.446	€ 337.252	5.495	0	5.495	0,16
BPS	07.2023	€ 324.064	$ 355.076	1.522	0	1.522	0,05
	07.2023	$ 369.879	€ 343.954	5.384	(10)	5.374	0,16
	08.2023	355.295	323.808	0	(1.535)	(1.535)	(0,05)
CBK	07.2023	€ 374.130	$ 405.991	0	(2.185)	(2.185)	(0,07)
	07.2023	$ 2.967	€ 2.747	30	(1)	29	0,00
	08.2023	347.432	319.116	1.200	0	1.200	0,04
JPM	07.2023	€ 325.951	$ 355.906	293	0	293	0,01
	07.2023	$ 364.302	€ 340.734	7.439	0	7.439	0,22
	08.2023	356.403	325.951	0	(304)	(304)	(0,01)
MBC	07.2023	€ 2.698	$ 2.890	0	(54)	(54)	0,00
	07.2023	$ 770	€ 716	12	(1)	11	0,00
SCX	07.2023	9.670	9.036	188	0	188	0,01
				$ 21.564	$ (4.093)	$ 17.471	0,52

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklassen Institutional GBP (Hedged) thesaurierend und Institutional GBP (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2023	£ 1.078	$ 1.370	$ 0	$ (1)	$ (1)	0,00
BPS	07.2023	278	346	1	(8)	(7)	0,00
	07.2023	$ 122.460	£ 99.007	3.412	0	3.412	0,10
BRC	07.2023	£ 1.485	$ 1.880	1	(9)	(8)	0,00
	07.2023	$ 338	£ 273	8	0	8	0,00
CBK	07.2023	£ 10.059	$ 12.781	1	(9)	(8)	0,00
	07.2023	$ 2.397	£ 1.911	33	0	33	0,00
JPM	07.2023	£ 94.765	$ 119.821	0	(659)	(659)	(0,02)
	08.2023	$ 119.847	£ 94.765	657	0	657	0,02
MBC	07.2023	£ 229	$ 293	2	0	2	0,00
	07.2023	$ 122.876	£ 99.258	3.315	0	3.315	0,10
MYI	07.2023	122.052	98.202	2.798	0	2.798	0,09
TOR	07.2023	£ 94.962	$ 120.668	0	(62)	(62)	0,00
	08.2023	$ 120.694	£ 94.962	60	0	60	0,00
				$ 10.288	$ (748)	$ 9.540	0,29

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklasse Institutional NOK (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2023	NOK 1.767	$ 166	$ 1	$ 0	$ 1	0,00
	07.2023	$ 247.051	NOK 2.734.562	8.196	(4)	8.192	0,25
BPS	07.2023	NOK 1.545.613	$ 143.765	0	(501)	(501)	(0,01)
	07.2023	$ 354	NOK 3.886	9	0	9	0,00
	08.2023	143.765	1.544.092	506	0	506	0,02
CBK	07.2023	122.445	1.373.378	5.744	0	5.744	0,17
GLM	07.2023	NOK 1.634.758	$ 151.669	0	(919)	(919)	(0,03)
	08.2023	$ 151.669	NOK 1.633.151	924	0	924	0,03
MBC	07.2023	5.529	60.386	107	0	107	0,00
MYI	07.2023	183	1.980	2	0	2	0,00
RYL	07.2023	1.746	18.810	10	0	10	0,00
SCX	07.2023	1.123	12.123	9	0	9	0,00

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
TOR	07.2023	$ 3.566	NOK 39.483	$ 119	$ 0	$ 119	0,00
UAG	07.2023	154.376	1.708.238	5.071	0	5.071	0,15
				$ 20.698	$ (1.424)	$ 19.274	0,58

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklasse Institutional NZD (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2023	$ 12.158	NZD 20.039	$ 119	$ 0	$ 119	0,00
BRC	07.2023	NZD 22.129	$ 13.456	0	(101)	(101)	0,00
	07.2023	$ 8.950	NZD 14.909	183	0	183	0,01
	08.2023	13.455	22.129	101	0	101	0,00
CBK	07.2023	NZD 302	$ 182	0	(3)	(3)	0,00
MYI	07.2023	$ 9.796	NZD 16.186	120	0	120	0,00
RYL	07.2023	1	1	0	0	0	0,00
SCX	07.2023	9.349	15.398	85	0	85	0,00
				$ 608	$ (104)	$ 504	0,01

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklassen Institutional SEK (Hedged) thesaurierend und Administrative SEK (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2023	SEK 187.093	$ 17.421	$ 100	$ (1)	$ 99	0,00
	07.2023	$ 97	SEK 1.056	1	0	1	0,00
	08.2023	4.636	49.970	0	(4)	(4)	0,00
BRC	07.2023	SEK 79.891	$ 7.475	79	0	79	0,00
	07.2023	$ 304	SEK 3.255	0	(3)	(3)	0,00
CBK	07.2023	SEK 51.306	$ 4.768	18	0	18	0,00
	07.2023	$ 10.071	SEK 110.001	113	0	113	0,01
GLM	07.2023	SEK 93	$ 9	0	0	0	0,00
	07.2023	$ 33	SEK 357	0	0	0	0,00
MBC	07.2023	9.500	102.313	0	(28)	(28)	0,00
MYI	07.2023	SEK 101.359	$ 9.404	20	0	20	0,00
	07.2023	$ 14.104	SEK 151.418	0	(86)	(86)	0,00
	08.2023	4.636	49.991	0	(2)	(2)	0,00
SCX	07.2023	SEK 1.845	$ 171	1	(1)	0	0,00
	07.2023	$ 9.535	SEK 103.135	13	0	13	0,00
				$ 345	$ (125)	$ 220	0,01

Summe Freiverkehrsfinanzderivate	**$ 112.365**	**3,36**

LEERVERKAUFTE WERTPAPIERE

BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
US-REGIERUNGSBEHÖRDEN			
Uniform Mortgage-Backed Security, TBA			
2,000 % fällig am 01.07.2038	$ 29.000	$ (25.701)	(0,77)
2,000 % fällig am 01.08.2053	114.550	(93.578)	(2,79)
4,000 % fällig am 01.08.2053	5.300	(4.978)	(0,15)
Summe Leerverkaufte Wertpapiere		**$ (124.257)**	**(3,71)**
Summe Anlagen		**$ 3.836.752**	**114,71**
Sonstige Aktiva und Passiva		**$ (491.918)**	**(14,71)**
Nettovermögen		**$ 3.344.834**	**100,00**

ERLÄUTERUNGEN ZUR AUFSTELLUNG DES WERTPAPIERBESTANDS (Angaben in Tausend*):

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

^ Das Wertpapier ist in Verzug.

(a) Nullkuponwertpapier.

(b) Der Kupon stellt eine Rendite bis zur Endfälligkeit dar.

(c) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

(d) Bedingt wandelbares Wertpapier.

Barmittel in Höhe von 78.239 USD (31. Dezember 2022: 78.217 USD) wurden zum 30. Juni 2023 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Barmittel in Höhe von 370 USD (31. Dezember 2022: 44.770 USD) wurden zum 30. Juni 2023 gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. als Sicherheit für Finanzderivate verpfändet.

Beizulegender Zeitwert[1]

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 30. Juni 2023 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie[2]	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	$ 0	$ 3.663.012	$ 81	$ 3.663.093
Pensionsgeschäfte	0	206.285	0	206.285
Finanzderivate[3]	5.612	86.019	0	91.631
Leerverkaufte Wertpapiere	0	(124.257)	0	(124.257)
Summen	**$ 5.612**	**$ 3.831.059**	**$ 81**	**$ 3.836.752**

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

Kategorie[2]	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	$ 0	$ 2.913.880	$ 0	$ 2.913.880
Investmentfonds	5.649	0	0	5.649
Pensionsgeschäfte	0	1.157.847	0	1.157.847
Finanzderivate[3]	10.275	(67.767)	0	(57.492)
Leerverkaufte Wertpapiere	0	(119.122)	0	(119.122)
Summen	**$ 15.924**	**$ 3.884.838**	**$ 0**	**$ 3.900.762**

(1) Weitere Informationen finden Sie in den Erläuterungen in Erläuterung 3.

(2) Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung des Wertpapierbestands.

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

Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC-Finanzderivate und -Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2023 und 31. Dezember 2022:

	Zum 30. Jun. 2023			Zum 31. Dez. 2022		
Kontrahent	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-engagement[1]	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-engagement[1]
AZD	$ 510	$ (370)	$ 140	$ 569	$ (270)	$ 299
BOA	15.557	(11.790)	3.767	(19.412)	16.030	(3.382)
BOM	k. A.	k. A.	k. A.	68	0	68
BPS	4.605	(3.010)	1.595	(119)	70	(49)
BRC	10.201	(9.860)	341	511	(350)	161
BSH	21	0	21	k. A.	k. A.	k. A.
CBK	10.820	(10.210)	610	21.756	(21.180)	576
FAR	(100)	320	220	k. A.	k. A.	k. A.
GLM	1.253	(1.200)	53	(1.813)	1.600	(213)
GSC	k. A.	k. A.	k. A.	(6)	0	(6)
GST	13	0	13	(69)	70	1
HUS	k. A.	k. A.	k. A.	(2)	0	(2)
JPM	11.895	(10.640)	1.255	634	(560)	74
MBC	27.618	(27.110)	508	(11.665)	10.830	(835)
MYC	(198)	50	(148)	(127)	50	(77)
MYI	2.978	(2.070)	908	(1.837)	1.310	(527)
RBC	(6)	0	(6)	128	0	128
RYL	89	0	89	(29)	0	(29)
SCX	1.713	(1.100)	613	9.488	(8.580)	908
SSB	7.475	(7.620)	(145)	488	(420)	68
TOR	1.493	(1.050)	443	(8.559)	7.570	(989)
UAG	16.428	(14.040)	2.388	(8.383)	7.240	(1.143)

(1) Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären.

Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung des Wertpapierbestands zum 30. Juni 2023:

	30. Jun. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	60,44	34,52
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	49,07	58,42
Sonstige übertragbare Wertpapiere	k. A.	0,85
Investmentfonds	k. A.	0,18
Pensionsgeschäfte	6,17	37,28
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	0,20	0,30
Zentral abgerechnete Finanzderivate	(0,82)	(1,56)
Freiverkehrsfinanzderivate	3,36	(0,59)
Leerverkaufte Wertpapiere	(3,71)	(3,83)

Das Anlageportfolio des Fonds konzentriert sich zum 30. Juni 2023 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	30. Jun. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
Unternehmensanleihen und Wechsel	19,46	15,77
Kommunalanleihen und Wechsel	0,11	0,00
US-Regierungsbehörden	34,82	16,84
US-Schatzobligationen	6,40	3,33
Non-Agency-MBS	3,23	3,93
Forderungsbesicherte Wertpapiere	7,61	8,18
Staatsemissionen	16,49	10,32
Vorzugswertpapiere	k. A.	0,00
Kurzfristige Instrumente	21,39	35,42
Investmentfonds	k. A.	0,18
Pensionsgeschäfte	6,17	37,28
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	0,21	0,30
Verkaufsoptionen		
Optionen auf börsengehandelte Terminkontrakte	(0,01)	0,00
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	k. A.	0,00
Zinsswaps — Basisswaps	k. A.	0,00
Zinsswaps	(0,82)	(1,56)
Freiverkehrsfinanzderivate		
Optionskauf		
Zinsswapoptionen	0,02	0,03
Optionen auf Wertpapiere	0,03	0,03
Verkaufsoptionen		
Zinsswapoptionen	(0,12)	(0,15)
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen - Schutzkauf	k. A.	0,00
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	0,00	0,00
Cross-Currency Swaps	0,00	0,00
Zinsswaps	0,02	(0,01)
Devisenterminkontrakte	1,71	(1,97)
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	1,70	1,48
Leerverkaufte Wertpapiere	(3,71)	(3,83)
Sonstige Aktiva und Passiva	(14,71)	(25,57)
Nettovermögen	100,00	100,00

BESCHREIBUNG		PAR (000S)		MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE					
AUSTRALIEN					
FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE					
Pepper SPARKZ Trust					
5,160 % fällig am 17.08.2028	AUD	368	$	245	0,03
NON-AGENCY-MBS					
RESIMAC Bastille Trust					
6,093 % fällig am 05.09.2057	$	134		134	0,02
STAATSEMISSIONEN					
Australia Government International Bond					
0,500 % fällig am 21.09.2026	AUD	12.200		7.268	0,99
1,000 % fällig am 21.12.2030		1.100		592	0,08
1,000 % fällig am 21.11.2031		1.200		629	0,09
1,250 % fällig am 21.05.2032		900		476	0,06
1,750 % fällig am 21.06.2051		1.300		504	0,07
2,500 % fällig am 21.05.2030		800		485	0,07
4,500 % fällig am 21.04.2033		3.900		2.695	0,37
				12.649	1,73
Summe Australien				13.028	1,78
BELGIEN					
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL					
KBC Group NV					
5,796 % fällig am 19.01.2029	$	800		795	0,11
KANADA					
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL					
Fairfax Financial Holdings Ltd.					
2,750 % fällig am 29.03.2028	€	1.600		1.572	0,21
STAATSEMISSIONEN					
Canada Government International Bond					
1,750 % fällig am 01.12.2053	CAD	1.050		586	0,08
2,000 % fällig am 01.12.2051		650		389	0,05
2,750 % fällig am 01.12.2048		400		282	0,04
Canadian Government Real Return Bond					
1,500 % fällig am 01.12.2044 (d)		947		716	0,10
Ontario Teachers' Finance Trust					
0,900 % fällig am 20.05.2041	€	700		500	0,07
1,850 % fällig am 03.05.2032		3.300		3.137	0,43
Province of Ontario					
0,010 % fällig am 25.11.2030		2.300		1.966	0,27
				7.576	1,04
Summe Kanada				9.148	1,25
CAYMAN INSELN					
FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE					
Apidos CLO					
6,260 % fällig am 20.04.2031	$	2.400		2.377	0,33
BlueMountain CLO Ltd.					
6,340 % fällig am 15.07.2031		2.000		1.974	0,27
Catamaran CLO Ltd.					
6,373 % fällig am 22.04.2030		2.293		2.280	0,31
CBAM Ltd.					
6,280 % fällig am 17.04.2031		2.000		1.977	0,27
LCM LP					
6,290 % fällig am 20.10.2027		276		277	0,04
Regatta Funding Ltd.					
6,510 % fällig am 17.10.2030		992		988	0,13
TIAA CLO Ltd.					
6,450 % fällig am 20.07.2031		2.200		2.173	0,30
Venture CLO Ltd.					
6,140 % fällig am 15.04.2027		243		242	0,03
6,300 % fällig am 20.07.2030		2.409		2.386	0,33
Voya CLO Ltd.					
6,458 % fällig am 15.10.2030		1.646		1.641	0,22
				16.315	2,23
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL					
Gaci First Investment Co.					
4,750 % fällig am 14.02.2030		1.400		1.380	0,19
4,875 % fällig am 14.02.2035		1.500		1.440	0,20
5,125 % fällig am 14.02.2053		700		631	0,09
KSA Sukuk Ltd.					
5,268 % fällig am 25.10.2028	$	600	$	613	0,08

BESCHREIBUNG		PAR (000S)		MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
QNB Finance Ltd.					
1,375 % fällig am 26.01.2026		200		181	0,02
Sands China Ltd.					
5,625 % fällig am 08.08.2025		500		488	0,07
5,900 % fällig am 08.08.2028		900		859	0,12
U.S. Capital Funding Ltd.					
6,049 % fällig am 01.08.2034		66		65	0,01
				5.657	0,78
Summe Cayman Inseln				21.972	3,01
CHINA					
STAATSEMISSIONEN					
China Development Bank					
4,040 % fällig am 10.04.2027	CNY	1.580		229	0,03
China Government International Bond					
2,370 % fällig am 20.01.2027		25.000		3.442	0,47
2,440 % fällig am 15.10.2027		149.740		20.639	2,83
3,010 % fällig am 13.05.2028		13.300		1.882	0,26
3,190 % fällig am 15.04.2053		1.100		157	0,02
3,530 % fällig am 18.10.2051		29.100		4.339	0,59
Summe China				30.688	4,20
DÄNEMARK					
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL					
Jyske Realkredit A/S					
1,000 % fällig am 01.10.2050	DKK	39.574		3.969	0,54
1,500 % fällig am 01.10.2037		0		0	0,00
1,500 % fällig am 01.07.2050		0		0	0,00
1,500 % fällig am 01.10.2050		0		0	0,00
1,500 % fällig am 01.10.2053		2.084		216	0,03
2,000 % fällig am 01.10.2047		0		0	0,00
Nordea Kredit Realkreditaktieselskab					
1,000 % fällig am 01.10.2050		37.949		3.846	0,53
1,500 % fällig am 01.10.2037		0		0	0,00
1,500 % fällig am 01.10.2050		0		0	0,00
1,500 % fällig am 01.10.2053		5.962		658	0,09
2,000 % fällig am 01.10.2047		0		0	0,00
2,500 % fällig am 01.10.2047		0		0	0,00
Nykredit Realkredit A/S					
1,000 % fällig am 01.04.2024		7.300		1.050	0,14
1,000 % fällig am 01.10.2050		40.406		4.236	0,58
1,500 % fällig am 01.10.2037		0		0	0,00
1,500 % fällig am 01.10.2050		0		0	0,00
1,500 % fällig am 01.10.2053		23.189		2.440	0,33
2,000 % fällig am 01.10.2047		0		0	0,00
2,000 % fällig am 01.10.2050		0		0	0,00
2,500 % fällig am 01.10.2036		0		0	0,00
2,500 % fällig am 01.10.2047		0		0	0,00
Realkredit Danmark A/S					
1,000 % fällig am 01.10.2050		13.491		1.421	0,20
2,000 % fällig am 01.10.2047		0		0	0,00
2,000 % fällig am 01.10.2053		0		0	0,00
2,500 % fällig am 01.04.2036		0		0	0,00
2,500 % fällig am 01.04.2047		0		0	0,00
Summe Dänemark				17.836	2,44
FRANKREICH					
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL					
Societe Generale S.A.					
1,488 % fällig am 14.12.2026	$	700		616	0,08
2,797 % fällig am 19.01.2028		700		621	0,09
3,337 % fällig am 21.01.2033		2.100		1.683	0,23
				2.920	0,40
STAATSEMISSIONEN					
Agence Francaise de Developpement					
1,125 % fällig am 02.03.2037	€	2.900		2.365	0,32
France Government International Bond					
0,500 % fällig am 25.05.2072		900		387	0,05
0,750 % fällig am 25.05.2052		8.100		4.819	0,66
2,000 % fällig am 25.05.2048		11.500		9.925	1,36
3,250 % fällig am 25.05.2045		200		219	0,03
				17.715	2,42
Summe Frankreich				20.635	2,82
DEUTSCHLAND					
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL					

BESCHREIBUNG		PAR (000S)		MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
Deutsche Bank AG					
0,050 % fällig am 20.11.2024	€	4.900	$	5.059	0,69
1,000 % fällig am 19.11.2025		100		103	0,01
1,375 % fällig am 03.09.2026		3.400		3.410	0,47
1,375 % fällig am 17.02.2032		1.500		1.214	0,17
1,625 % fällig am 20.01.2027		3.300		3.202	0,44
1,750 % fällig am 19.11.2030		1.000		863	0,12
3,729 % fällig am 14.01.2032 (g)	$	300		227	0,03
3,961 % fällig am 26.11.2025		900		859	0,12
Kreditanstalt fuer Wiederaufbau					
5,000 % fällig am 19.03.2024	AUD	100		67	0,01
Landwirtschaftliche Rentenbank					
5,375 % fällig am 23.04.2024	NZD	1.100		671	0,09
Summe Deutschland				15.675	2,15
UNGARN					
STAATSEMISSIONEN					
Hungary Government International Bond					
5,000 % fällig am 22.02.2027	€	200		220	0,03
6,250 % fällig am 22.09.2032	$	1.000		1.027	0,14
Summe Ungarn				1.247	0,17
IRLAND					
FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE					
Accunia European CLO DAC					
4,127 % fällig am 15.07.2030	€	568		612	0,08
Armada Euro CLO DAC					
3,897 % fällig am 15.07.2031		800		853	0,12
Aurium CLO DAC					
3,907 % fällig am 16.01.2031		2.097		2.244	0,31
Black Diamond CLO DAC					
4,303 % fällig am 15.05.2032		2.400		2.562	0,35
BNPP AM Euro CLO DAC					
4,031 % fällig am 22.07.2032		2.200		2.345	0,32
Cairn CLO DAC					
3,842 % fällig am 30.04.2031		1.577		1.686	0,23
3,957 % fällig am 15.10.2031		850		909	0,12
Carlyle Euro CLO DAC					
3,877 % fällig am 15.01.2031		1.493		1.595	0,22
Carlyle Global Market Strategies Euro CLO DAC					
4,137 % fällig am 16.01.2033		1.900		2.009	0,27
Dryden Euro CLO DAC					
3,837 % fällig am 15.04.2033		1.200		1.281	0,17
4,183 % fällig am 15.05.2034		1.200		1.281	0,17
GoldenTree Loan Management EUR CLO DAC					
4,100 % fällig am 20.01.2032		2.000		2.128	0,29
Griffith Park CLO DAC					
4,103 % fällig am 21.11.2031		1.000		1.070	0,15
Harvest CLO DAC					
3,880 % fällig am 20.10.2031		1.000		1.069	0,15
3,937 % fällig am 15.07.2031		2.100		2.236	0,31
4,027 % fällig am 15.01.2032		2.100		2.242	0,31
Jubilee CLO DAC					
3,777 % fällig am 15.04.2030		1.200		1.279	0,17
3,827 % fällig am 15.04.2031		800		852	0,12
4,326 % fällig am 15.12.2029		176		190	0,03
Laurelin DAC					
3,920 % fällig am 20.10.2031		2.100		2.250	0,31
Madison Park Euro Funding DAC					
3,977 % fällig am 15.07.2032		2.200		2.341	0,32
Oak Hill European Credit Partners DAC					
3,940 % fällig am 20.10.2031		2.200		2.337	0,32
Palmer Square European Loan Funding DAC					
3,897 % fällig am 15.10.2031		2.392		2.558	0,35
Sculptor European CLO DAC					
3,916 % fällig am 14.01.2032		2.100		2.251	0,31
Segovia European CLO DAC					
4,080 % fällig am 20.07.2032		2.000		2.126	0,29
Toro European CLO DAC					
4,133 % fällig am 15.02.2034		2.200		2.336	0,32
				44.642	6,11

BESCHREIBUNG		PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
AerCap Ireland Capital DAC				
1,150 % fällig am 29.10.2023	$	600	$ 590	0,08
1,650 % fällig am 29.10.2024		500	470	0,06
1,750 % fällig am 29.10.2024		500	470	0,06
			1.530	0,20
Summe Irland			46.172	6,31
ISRAEL				
STAATSEMISSIONEN				
Israel Government International Bond				
0,150 % fällig am 31.07.2023	ILS	13.100	3.517	0,48
1,500 % fällig am 30.11.2023		11.000	2.927	0,40
2,000 % fällig am 31.03.2027		7.600	1.916	0,26
4,500 % fällig am 17.01.2033	$	500	493	0,07
Summe Israel			8.853	1,21
ITALIEN				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
AMCO - Asset Management Co. SpA				
1,500 % fällig am 17.07.2023	€	777	847	0,12
4,625 % fällig am 06.02.2027		1.100	1.193	0,16
Banca Monte dei Paschi di Siena SpA				
0,875 % fällig am 08.10.2027		200	195	0,03
2,000 % fällig am 29.01.2024		2.200	2.369	0,32
2,625 % fällig am 28.04.2025		100	102	0,01
UniCredit SpA				
7,830 % fällig am 04.12.2023	$	2.800	2.817	0,39
			7.523	1,03
STAATSEMISSIONEN				
Cassa Depositi e Prestiti SpA				
5,750 % fällig am 05.05.2026		1.100	1.086	0,15
Italy Government International Bond				
6,000 % fällig am 04.08.2028	£	100	124	0,02
			1.210	0,17
Summe Italien			8.733	1,20
JAPAN				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Mizuho Financial Group, Inc.				
3,922 % fällig am 11.09.2024	$	1.000	995	0,14
6,540 % fällig am 11.09.2024		1.500	1.502	0,21
Sumitomo Mitsui Banking Corp.				
0,409 % fällig am 07.11.2029	€	1.800	1.602	0,22
Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd.				
0,010 % fällig am 15.10.2027		2.000	1.854	0,25
			5.953	0,82
STAATSEMISSIONEN				
Japan Government International Bond				
0,005 % fällig am 01.03.2024	¥	620.000	4.294	0,59
0,005 % fällig am 01.04.2024		690.000	4.780	0,66
0,005 % fällig am 01.05.2024		310.000	2.147	0,29
0,005 % fällig am 01.10.2024		1.320.000	9.148	1,25
0,100 % fällig am 10.03.2028 (d)		1.024.212	7.469	1,02
0,500 % fällig am 20.03.2049		976.000	5.723	0,78
0,700 % fällig am 20.12.2048		1.188.000	7.353	1,01
0,700 % fällig am 20.09.2051		660.000	3.972	0,54
Tokyo Metropolitan Government				
0,750 % fällig am 16.07.2025	$	800	730	0,10
			45.616	6,24
Summe Japan			51.569	7,06
LUXEMBURG				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Aroundtown S.A.				
0,000 % fällig am 16.07.2026 (b)	€	700	586	0,08
0,375 % fällig am 15.04.2027		100	78	0,01
CPI Property Group S.A.				
2,750 % fällig am 12.05.2026		2.100	1.865	0,26
Cromwell Ereit Lux Finco SARL				
2,125 % fällig am 19.11.2025		500	471	0,07
Logicor Financing SARL				
0,625 % fällig am 17.11.2025	€	1.400	$ 1.340	0,18
			4.340	0,60
NON-AGENCY-MBS				
Miravet SARL				
4,265 % fällig am 26.05.2065		900	967	0,13
Summe Luxemburg			5.307	0,73
MALAYSIA				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Petronas Capital Ltd.				
2,480 % fällig am 28.01.2032	$	400	334	0,04
3,500 % fällig am 21.04.2030		400	370	0,05
4,550 % fällig am 21.04.2050		300	276	0,04
4,800 % fällig am 21.04.2060		300	283	0,04
			1.263	0,17
STAATSEMISSIONEN				
Malaysia Government International Bond				
2,632 % fällig am 15.04.2031	MYR	2.157	425	0,06
3,885 % fällig am 15.08.2029		10.179	2.198	0,30
Malaysia Government Investment Issue				
3,465 % fällig am 15.10.2030		3.002	629	0,09
			3.252	0,45
Summe Malaysia			4.515	0,62
MEXIKO				
STAATSEMISSIONEN				
Mexico Government International Bond				
4,000 % fällig am 15.03.2115	€	400	323	0,04
MULTINATIONAL				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Preferred Term Securities Ltd.				
5,914 % fällig am 23.06.2035	$	849	798	0,11
NIEDERLANDE				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Cooperatieve Rabobank UA				
3,758 % fällig am 06.04.2033		600	522	0,07
CTP NV				
0,625 % fällig am 27.09.2026	€	600	529	0,07
0,875 % fällig am 20.01.2026		900	839	0,12
1,500 % fällig am 27.09.2031		600	457	0,06
ING Groep NV				
2,125 % fällig am 23.05.2026		400	416	0,06
			2.763	0,38
NON-AGENCY-MBS				
Jubilee Place BV				
4,177 % fällig am 17.10.2057		887	967	0,13
Summe Niederlande			3.730	0,51
NEUSEELAND				
STAATSEMISSIONEN				
New Zealand Government International Bond				
1,500 % fällig am 15.05.2031	NZD	1.300	636	0,09
NORWEGEN				
STAATSEMISSIONEN				
Kommunalbanken A/S				
1,900 % fällig am 19.01.2027	AUD	1.600	968	0,13
Norway Government International Bond				
1,750 % fällig am 13.03.2025	NOK	6.300	565	0,08
Summe Norwegen			1.533	0,21
PERU				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Banco de Credito del Peru S.A.				
4,650 % fällig am 17.09.2024	PEN	2.400	635	0,09
STAATSEMISSIONEN				
Peru Government International Bond				
6,150 % fällig am 12.08.2032	PEN	100	$ 26	0,00
Summe Peru			661	0,09
POLEN				
STAATSEMISSIONEN				
Poland Government International Bond				
3,875 % fällig am 14.02.2033	€	900	975	0,13
4,250 % fällig am 14.02.2043		200	215	0,03
4,875 % fällig am 04.10.2033	$	500	492	0,07
5,500 % fällig am 16.11.2027		200	205	0,03
5,500 % fällig am 04.04.2053		400	404	0,05
Summe Polen			2.291	0,31
PORTUGAL				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Banco Espirito Santo S.A.				
4,000 % fällig am 21.01.2019 ^	€	400	107	0,01
4,750 % fällig am 15.01.2018 ^		700	187	0,03
EDP - Energias de Portugal S.A.				
2,375 % fällig am 27.11.2023		800	867	0,12
Summe Portugal			1.161	0,16
KATAR				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
QatarEnergy				
2,250 % fällig am 12.07.2031	$	400	336	0,05
RUMÄNIEN				
STAATSEMISSIONEN				
Romania Government International Bond				
1,375 % fällig am 02.12.2029	€	630	534	0,07
1,750 % fällig am 13.07.2030		1.000	834	0,11
2,000 % fällig am 28.01.2032		600	481	0,07
2,000 % fällig am 14.04.2033		700	541	0,07
2,124 % fällig am 16.07.2031		400	332	0,05
2,625 % fällig am 02.12.2040		600	400	0,05
2,875 % fällig am 13.04.2042		800	538	0,07
3,750 % fällig am 07.02.2034		800	707	0,10
5,000 % fällig am 27.09.2026		1.700	1.864	0,26
Summe Rumänien			6.231	0,85
SAUDI-ARABIEN				
STAATSEMISSIONEN				
Saudi Arabia Government International Bond				
3,250 % fällig am 22.10.2030	$	400	363	0,05
4,750 % fällig am 18.01.2028		1.900	1.886	0,26
4,875 % fällig am 18.07.2033		2.200	2.201	0,30
Summe Saudi-Arabien			4.450	0,61
SERBIEN				
STAATSEMISSIONEN				
Serbia Government International Bond				
1,000 % fällig am 23.09.2028	€	600	508	0,07
2,050 % fällig am 23.09.2036		900	604	0,08
Summe Serbien			1.112	0,15
SINGAPUR				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Pfizer Investment Enterprises Pte. Ltd.				
4,650 % fällig am 19.05.2030	$	600	593	0,08
SLOWENIEN				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Nova Kreditna Banka Maribor d.d.				
1,875 % fällig am 27.01.2025	€	700	739	0,10
Nova Ljubljanska Banka d.d.				
3,400 % fällig am 05.02.2030		1.000	927	0,13
Summe Slowenien			1.666	0,23

BESCHREIBUNG		PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
SÜDKOREA				
STAATSEMISSIONEN				
South Korea Government International Bond				
2,000 % fällig am 10.06.2031	KRW	1.769.360	$ 1.191	0,16
2,125 % fällig am 10.06.2027		2.095.000	1.501	0,21
2,375 % fällig am 10.12.2027		2.480.000	1.783	0,24
2,375 % fällig am 10.12.2028		10.348.000	7.350	1,01
2,625 % fällig am 10.06.2028		4.190.000	3.030	0,41
3,250 % fällig am 10.06.2033		4.800.300	3.523	0,48
4,250 % fällig am 10.12.2032		10.509.430	8.335	1,14
5,500 % fällig am 10.03.2028		2.480.000	2.030	0,28
Summe Südkorea			28.743	3,93
SPANIEN				
FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE				
BBVA Consumer Auto				
0,270 % fällig am 20.07.2031	€	342	363	0,05
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Banco Santander S.A.				
1,849 % fällig am 25.03.2026	$	200	179	0,03
CaixaBank S.A.				
1,750 % fällig am 24.10.2023	€	900	975	0,13
			1.154	0,16
STAATSEMISSIONEN				
Autonomous Community of Catalonia				
4,220 % fällig am 26.04.2035		400	433	0,06
Spain Government International Bond				
1,450 % fällig am 31.10.2071		2.200	1.165	0,16
1,900 % fällig am 31.10.2052		300	217	0,03
3,450 % fällig am 30.07.2066		4.200	4.179	0,57
5,250 % fällig am 06.04.2029	£	500	622	0,08
			6.616	0,90
Summe Spanien			8.133	1,11
ÜBERNATIONAL				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Europäische Bank für Wiederaufbau und Entwicklung				
0,500 % fällig am 21.12.2023	AUD	3.100	2.021	0,28
Europäische Investitionsbank				
0,500 % fällig am 21.07.2023		1.200	797	0,11
Inter-American Development Bank				
2,500 % fällig am 14.04.2027		1.300	804	0,11
Summe Supranational			3.622	0,50
SCHWEDEN				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
EQT AB				
2,375 % fällig am 06.04.2028	€	700	674	0,09
SCHWEIZ				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Credit Suisse AG				
3,625 % fällig am 09.09.2024	$	500	482	0,07
6,500 % fällig am 08.08.2023 (f)		700	698	0,10
UBS Group AG				
0,650 % fällig am 10.09.2029	€	700	600	0,08
3,869 % fällig am 12.01.2029	$	1.150	1.041	0,14
4,282 % fällig am 09.01.2028		450	416	0,06
4,488 % fällig am 12.05.2026		400	387	0,05
4,550 % fällig am 17.04.2026		750	721	0,10
6,373 % fällig am 15.07.2026		1.250	1.242	0,17
6,442 % fällig am 11.08.2028		1.100	1.105	0,15
7,750 % fällig am 01.03.2029	€	600	726	0,10
9,016 % fällig am 15.11.2033	$	1.300	1.559	0,21
Summe Schweiz			8.977	1,23
VEREINIGTE ARABISCHE EMIRATE				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
MDGH GMTN RSC Ltd.				
5,500 % fällig am 28.04.2033		500	526	0,07

BESCHREIBUNG		PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
GROSSBRITANNIEN				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Barclays PLC				
4,375 % fällig am 12.01.2026	$	200	$ 192	0,03
6,224 % fällig am 09.05.2034		2.300	2.292	0,31
Haleon UK Capital PLC				
3,125 % fällig am 24.03.2025		1.200	1.147	0,16
HSBC Holdings PLC				
2,251 % fällig am 22.11.2027		2.300	2.043	0,28
2,804 % fällig am 24.05.2032		2.200	1.780	0,24
2,999 % fällig am 10.03.2026		500	474	0,06
4,041 % fällig am 13.03.2028		300	281	0,04
4,583 % fällig am 19.06.2029		1.300	1.225	0,17
NatWest Markets PLC				
1,000 % fällig am 28.05.2024	€	1.000	1.061	0,15
Santander UK Group Holdings PLC				
4,796 % fällig am 15.11.2024	$	1.700	1.687	0,23
Standard Chartered PLC				
1,822 % fällig am 23.11.2025		1.800	1.684	0,23
2,678 % fällig am 29.06.2032		2.700	2.118	0,29
TP ICAP Finance PLC				
2,625 % fällig am 18.11.2028	£	700	658	0,09
			16.642	2,28
NON-AGENCY-MBS				
Avon Finance PLC				
5,809 % fällig am 20.09.2048		1.138	1.446	0,20
Canada Square Funding PLC				
5,682 % fällig am 17.06.2058		1.168	1.477	0,20
Eurosail PLC				
5,940 % fällig am 13.06.2045		465	585	0,08
Genesis Mortgage Funding PLC				
6,081 % fällig am 15.09.2059		2.651	3.377	0,46
Mansard Mortgages PLC				
5,651 % fällig am 15.12.2049		406	505	0,07
Newgate Funding PLC				
4,126 % fällig am 15.12.2050	€	424	446	0,06
Polaris PLC				
5,631 % fällig am 23.12.2058	£	1.135	1.436	0,19
Ripon Mortgages PLC				
5,491 % fällig am 28.08.2056		5.584	7.074	0,97
Stratton Mortgage Funding PLC				
5,391 % fällig am 20.07.2060		2.311	2.938	0,40
5,765 % fällig am 12.03.2052		1.194	1.513	0,21
Towd Point Mortgage Funding PLC				
5,635 % fällig am 20.10.2051		1.043	1.328	0,18
5,841 % fällig am 20.07.2045		2.409	3.065	0,42
Trinity Square PLC				
5,316 % fällig am 15.07.2059		1.083	1.375	0,19
			26.565	3,63
STAATSEMISSIONEN				
United Kingdom Gilt				
0,625 % fällig am 22.10.2050		2.700	1.396	0,19
1,250 % fällig am 31.07.2051		3.500	2.208	0,30
1,500 % fällig am 31.07.2053		1.600	1.062	0,14
1,750 % fällig am 22.01.2049		2.200	1.656	0,23
3,250 % fällig am 22.01.2044		1.700	1.799	0,25
4,250 % fällig am 07.12.2040		1.700	2.094	0,29
			10.215	1,40
Summe Großbritannien			53.422	7,31
USA				
FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE				
Amortizing Residential Collateral Trust				
5,850 % fällig am 25.10.2031	$	2	2	0,00
Asset-Backed Funding Certificates Trust				
5,850 % fällig am 25.06.2034		92	90	0,01
Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust				
5,765 % fällig am 25.02.2036		2.294	2.228	0,31
Citigroup Mortgage Loan Trust				
5,470 % fällig am 25.12.2036		1.746	982	0,14
Countrywide Asset-Backed Certificates				
5,830 % fällig am 25.12.2036 ^		10	7	0,00

BESCHREIBUNG		PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
Countrywide Asset-Backed Certificates Trust				
5,290 % fällig am 25.06.2037	$	1.229	$ 1.134	0,16
5,290 % fällig am 25.07.2037		353	321	0,04
Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp.				
4,599 % fällig am 25.01.2032		1	1	0,00
Home Equity Mortgage Trust				
6,000 % fällig am 25.01.2037 ^		261	238	0,03
IndyMac Home Equity Mortgage Loan Asset-Backed Trust				
4,100 % fällig am 25.03.2035		1.843	1.772	0,24
Long Beach Mortgage Loan Trust				
5,450 % fällig am 25.05.2036		1.118	650	0,09
Massachusetts Educational Financing Authority				
6,205 % fällig am 25.04.2038		81	81	0,01
MASTR Asset-Backed Securities Trust				
5,390 % fällig am 25.10.2036		2.075	1.849	0,25
5,470 % fällig am 25.08.2036		5.084	1.870	0,26
Merrill Lynch Mortgage Investors Trust				
5,310 % fällig am 25.09.2037		4	1	0,00
5,390 % fällig am 25.02.2037		3.040	915	0,13
Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust				
5,250 % fällig am 25.11.2036		1.119	616	0,08
5,400 % fällig am 25.07.2036		98	84	0,01
New Century Home Equity Loan Trust				
3,720 % fällig am 20.06.2031		256	227	0,03
Option One Mortgage Loan Trust				
5,290 % fällig am 25.01.2037		567	370	0,05
5,290 % fällig am 25.02.2037		2.046	1.345	0,18
Residential Asset Securities Corp. Trust				
5,810 % fällig am 25.11.2035		41	41	0,01
Securitized Asset-Backed Receivables LLC Trust				
5,270 % fällig am 25.12.2036 ^		14	3	0,00
SLC Student Loan Trust				
6,271 % fällig am 25.11.2042		354	352	0,05
Soundview Home Loan Trust				
5,555 % fällig am 25.12.2036		2.793	2.713	0,37
5,650 % fällig am 25.11.2036		2.119	1.967	0,27
5,855 % fällig am 25.11.2035		230	223	0,03
Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust				
6,670 % fällig am 25.04.2035		27	27	0,00
Wells Fargo Home Equity Asset-Backed Securities Trust				
5,495 % fällig am 25.01.2037		2.110	2.022	0,28
			22.131	3,03
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
AbbVie, Inc.				
1,500 % fällig am 15.11.2023	€	100	108	0,01
American Tower Corp.				
2,950 % fällig am 15.01.2025	$	1.400	1.340	0,18
3,800 % fällig am 15.08.2029		800	731	0,10
Bank of America Corp.				
1,949 % fällig am 27.10.2026	€	1.000	1.027	0,14
3,384 % fällig am 02.04.2026	$	600	575	0,08
Bayer U.S. Finance LLC				
6,562 % fällig am 15.12.2023		900	899	0,12
Broadcom, Inc.				
2,450 % fällig am 15.02.2031		600	488	0,07
Charter Communications Operating LLC				
3,500 % fällig am 01.03.2042		1.000	670	0,09
5,125 % fällig am 01.07.2049		700	551	0,08
6,384 % fällig am 23.10.2035		800	780	0,11
Citigroup, Inc.				
3,290 % fällig am 17.03.2026 (g)		2.200	2.105	0,29
Credit Suisse AG AT1 Claim ^		1.400	56	0,01
Doctors Co. An Interinsurance Exchange				
4,500 % fällig am 18.01.2032		200	159	0,02
Ford Motor Credit Co. LLC				
2,748 % fällig am 14.06.2024	£	600	730	0,10
2,900 % fällig am 16.02.2028	$	100	86	0,01
3,375 % fällig am 13.11.2025		800	745	0,10
4,687 % fällig am 09.06.2025		600	579	0,08
GA Global Funding Trust				
2,250 % fällig am 06.01.2027		600	532	0,07
Goldman Sachs Group, Inc.				
4,281 % fällig am 07.02.2025	€	1.000	1.096	0,15

BESCHREIBUNG		PAR (000S)		MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
Hyatt Hotels Corp.					
1,300 % fällig am 01.10.2023	$	500	$	495	0,07
JPMorgan Chase & Co.					
2,595 % fällig am 24.02.2026		1.800		1.708	0,23
Lehman Brothers Holdings, Inc.					
0,000 % fällig am 16.11.2009 ^		700		2	0,00
5,625 % fällig am 24.01.2013 ^		600		1	0,00
6,200 % fällig am 26.09.2014 ^		1.400		3	0,00
7,875 % fällig am 08.05.2018 ^	£	1.800		11	0,00
Morgan Stanley					
2,630 % fällig am 18.02.2026	$	1.300		1.233	0,17
Organon & Co.					
4,125 % fällig am 30.04.2028		400		355	0,05
Pacific Gas & Electric Co.					
2,100 % fällig am 01.08.2027		100		85	0,01
2,950 % fällig am 01.03.2026 ^		100		92	0,01
3,150 % fällig am 01.01.2026		100		93	0,01
3,450 % fällig am 01.07.2025		100		94	0,01
3,950 % fällig am 01.12.2047 ^		100		68	0,01
4,250 % fällig am 15.03.2046 ^		300		214	0,03
4,300 % fällig am 15.03.2045 ^		100		72	0,01
4,550 % fällig am 01.07.2030		200		181	0,03
Penske Truck Leasing Co. LP					
3,950 % fällig am 10.03.2025		1.500		1.443	0,20
Southern California Edison Co.					
5,922 % fällig am 01.04.2024		500		499	0,07
WEA Finance LLC					
3,750 % fällig am 17.09.2024		600		567	0,08
Wells Fargo & Co.					
3,908 % fällig am 25.04.2026		800		774	0,11
4,897 % fällig am 25.07.2033		1.600		1.536	0,21
				22.783	3,12
KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG					
CenturyLink, Inc.					
7,467 % fällig am 15.03.2027		818		633	0,09
KOMMUNALANLEIHEN UND WECHSEL					
Golden State, California Tobacco Securitization Corp. Revenue Notes, Series 2021					
2,158 % fällig am 01.06.2026		900		819	0,11
Texas Natural Gas Securitization Finance Corp. Revenue Bonds, Series 2023					
5,102 % fällig am 01.04.2035		400		402	0,06
				1.221	0,17
NON-AGENCY-MBS					
Adjustable Rate Mortgage Trust					
4,395 % fällig am 25.09.2035 ^		11		9	0,00
American Home Mortgage Assets Trust					
4,916 % fällig am 25.10.2046		875		614	0,08
5,340 % fällig am 25.05.2046 ^		187		157	0,02
Banc of America Funding Trust					
3,896 % fällig am 20.10.2046 ^		78		66	0,01
4,416 % fällig am 20.01.2047 ^		35		32	0,01
5,477 % fällig am 20.02.2047		687		597	0,08
Bear Stearns Adjustable Rate Mortgage Trust					
3,887 % fällig am 25.05.2047 ^		126		113	0,02
4,096 % fällig am 25.05.2034		11		9	0,00
4,342 % fällig am 25.08.2033		5		4	0,00
4,403 % fällig am 25.10.2033		6		6	0,00
Bear Stearns ALT-A Trust					
3,817 % fällig am 25.11.2036 ^		374		198	0,03
3,990 % fällig am 25.11.2035 ^		101		79	0,01
4,202 % fällig am 25.09.2035 ^		252		157	0,02
Bear Stearns Structured Products, Inc. Trust					
3,484 % fällig am 26.12.2046 ^		380		286	0,04
Chase Mortgage Finance Trust					
4,529 % fällig am 25.07.2037		42		32	0,00
Citigroup Mortgage Loan Trust					
3,974 % fällig am 25.09.2037 ^		232		204	0,03
Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.					
5,014 % fällig am 25.08.2035 ^		237		220	0,03
6,780 % fällig am 25.09.2035		16		15	0,00
Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc. Mortgage Pass-Through Certificates					
3,626 % fällig am 25.09.2035 ^		300		260	0,04
CitiMortgage Alternative Loan Trust					
5,750 % fällig am 25.02.2037	$	1.882	$	1.572	0,22
Countrywide Alternative Loan Trust					
3,940 % fällig am 25.02.2037 ^		108		93	0,01
5,250 % fällig am 25.06.2035 ^		18		14	0,00
5,337 % fällig am 20.02.2047 ^		726		566	0,08
5,367 % fällig am 20.07.2046 ^		178		143	0,02
5,476 % fällig am 25.11.2035		55		48	0,01
5,500 % fällig am 25.05.2037 ^		66		21	0,00
6,000 % fällig am 25.07.2037		1.992		1.028	0,14
6,016 % fällig am 25.11.2035		22		19	0,00
6,026 % fällig am 20.10.2035		1.135		825	0,11
6,250 % fällig am 25.08.2037 ^		53		28	0,00
6,500 % fällig am 25.06.2036 ^		154		78	0,01
6,690 % fällig am 25.11.2035		133		108	0,02
Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust					
3,810 % fällig am 25.11.2034		5		4	0,00
5,610 % fällig am 25.05.2035		20		17	0,00
5,790 % fällig am 25.03.2035		93		80	0,01
5,810 % fällig am 25.02.2035		48		44	0,01
5,910 % fällig am 25.09.2034		4		4	0,00
6,000 % fällig am 25.02.2037		913		456	0,06
Countrywide Home Loan Reperforming REMIC Trust					
5,490 % fällig am 25.06.2035		104		95	0,01
Deutsche ALT-A Securities Mortgage Loan Trust					
5,390 % fällig am 25.08.2036 ^		383		347	0,05
Deutsche ALT-B Securities Mortgage Loan Trust					
5,250 % fällig am 25.10.2036 ^		4		3	0,00
Downey Savings & Loan Association Mortgage Loan Trust					
5,677 % fällig am 19.08.2045		48		41	0,01
5,797 % fällig am 19.07.2045 ^		3		0	0,00
First Horizon Mortgage Pass-Through Trust					
4,715 % fällig am 25.08.2035		13		10	0,00
GreenPoint Mortgage Funding Trust					
5,690 % fällig am 25.11.2045		9		8	0,00
GSR Mortgage Loan Trust					
6,780 % fällig am 25.03.2033		4		4	0,00
HarborView Mortgage Loan Trust					
4,826 % fällig am 19.12.2036 ^		117		99	0,01
5,976 % fällig am 19.10.2035		379		213	0,03
Impac CMB Trust					
6,150 % fällig am 25.07.2033		1		1	0,00
IndyMac Mortgage Loan Trust					
3,327 % fällig am 25.03.2036		474		325	0,05
3,916 % fällig am 25.12.2034		8		8	0,00
JPMorgan Alternative Loan Trust					
5,500 % fällig am 25.11.2036 ^		2		1	0,00
5,630 % fällig am 25.10.2036		253		226	0,03
JPMorgan Mortgage Trust					
3,655 % fällig am 27.07.2037		168		152	0,02
3,854 % fällig am 25.11.2033		5		4	0,00
4,000 % fällig am 25.02.2036 ^		92		69	0,01
Madison Avenue Mortgage Trust					
3,673 % fällig am 10.09.2035		868		774	0,11
MASTR Alternative Loan Trust					
5,550 % fällig am 25.03.2036 ^		87		9	0,00
Mellon Residential Funding Corp. Mortgage Pass-Through Trust					
5,633 % fällig am 15.12.2030		10		9	0,00
Merrill Lynch Alternative Note Asset Trust					
5,370 % fällig am 25.03.2037		6.036		1.543	0,21
Residential Accredit Loans, Inc. Trust					
4,165 % fällig am 25.06.2046		792		193	0,03
5,091 % fällig am 25.11.2037		713		595	0,08
5,300 % fällig am 25.02.2047		164		62	0,01
5,450 % fällig am 25.06.2037 ^		313		278	0,04
5,470 % fällig am 25.03.2047		711		641	0,09
5,510 % fällig am 25.07.2036 ^		1.094		458	0,06
5,950 % fällig am 25.10.2045		64		54	0,01
6,000 % fällig am 25.06.2036		365		291	0,04
Residential Funding Mortgage Securities, Inc. Trust					
4,149 % fällig am 25.09.2035 ^		38		24	0,00
6,500 % fällig am 25.03.2032		0		0	0,00
Sequoia Mortgage Trust					
3,723 % fällig am 20.07.2037		449		363	0,05
5,857 % fällig am 20.07.2033		12		11	0,00
Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust					
5,282 % fällig am 25.02.2034	$	11	$	10	0,00
5,701 % fällig am 25.04.2034		9		9	0,00
Structured Asset Mortgage Investments Trust					
5,470 % fällig am 25.01.2037		1.045		922	0,13
5,530 % fällig am 25.07.2046 ^		327		236	0,03
5,570 % fällig am 25.05.2036		129		87	0,01
5,590 % fällig am 25.05.2036		630		506	0,07
5,726 % fällig am 19.07.2034		6		5	0,00
5,846 % fällig am 19.03.2034		2		2	0,00
Structured Asset Securities Corp.					
5,430 % fällig am 25.01.2036		161		128	0,02
Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust					
5,440 % fällig am 25.10.2036		457		383	0,05
Thornburg Mortgage Securities Trust					
7,151 % fällig am 25.06.2047 ^		86		76	0,01
Wachovia Mortgage Loan Trust					
1,560 % fällig am 25.01.2037		1.423		547	0,08
WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust					
3,626 % fällig am 25.09.2036		135		117	0,02
3,753 % fällig am 25.02.2037 ^		658		602	0,08
3,823 % fällig am 27.02.2034		6		6	0,00
3,824 % fällig am 25.06.2037 ^		103		92	0,01
3,974 % fällig am 25.05.2037 ^		387		343	0,05
4,280 % fällig am 25.03.2034		1		1	0,00
4,976 % fällig am 25.02.2046		187		167	0,02
5,770 % fällig am 25.01.2045		14		14	0,00
Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates Trust					
4,916 % fällig am 25.07.2046 ^		78		49	0,01
				19.419	2,66
US-REGIERUNGSBEHÖRDEN					
Fannie Mae					
2,944 % fällig am 25.07.2039		331		298	0,04
3,000 % fällig am 01.03.2060		787		696	0,10
3,500 % fällig am 01.01.2059		1.691		1.544	0,21
3,621 % fällig am 01.12.2034		9		9	0,00
4,415 % fällig am 01.11.2034		42		43	0,01
4,944 % fällig am 01.09.2044		37		36	0,01
5,103 % fällig am 25.03.2036		3		3	0,00
5,258 % fällig am 25.03.2034		3		3	0,00
5,288 % fällig am 25.08.2034		2		2	0,00
5,550 % fällig am 25.06.2036		17		17	0,00
5,650 % fällig am 25.10.2040		37		36	0,00
6,000 % fällig am 25.04.2043 - 25.07.2044		82		82	0,01
Freddie Mac					
0,000 % fällig am 15.01.2038 (a)		282		12	0,00
4,021 % fällig am 01.09.2035		1		1	0,00
4,348 % fällig am 15.01.2038		282		274	0,04
5,176 % fällig am 25.10.2044 - 25.02.2045		171		159	0,02
5,793 % fällig am 15.12.2037 - 15.07.2040		124		123	0,02
6,150 % fällig am 25.05.2043		19		19	0,00
Ginnie Mae					
3,000 % fällig am 20.07.2046 - 20.05.2047		23		21	0,00
Uniform Mortgage-Backed Security					
2,500 % fällig am 01.02.2051 - 01.01.2052		2.756		2.345	0,32
3,000 % fällig am 01.04.2043 - 01.06.2051		1.890		1.680	0,23
3,500 % fällig am 01.10.2034 - 01.07.2050		1.470		1.368	0,19
4,000 % fällig am 01.06.2050		720		683	0,09
Uniform Mortgage-Backed Security, TBA					
4,000 % fällig am 01.08.2053		29.100		27.335	3,74
4,500 % fällig am 01.08.2053		42.300		40.691	5,57
5,000 % fällig am 01.08.2053		21.700		21.268	2,91
5,500 % fällig am 01.08.2053		29.100		28.957	3,96
6,000 % fällig am 01.08.2053		58.200		58.705	8,04
6,500 % fällig am 01.07.2053		58.300		59.526	8,15
				245.936	33,66
US-SCHATZOBLIGATIONEN					
U.S. Treasury Bonds					
1,625 % fällig am 15.11.2050		400		249	0,03

BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
4,000 % fällig am 15.11.2052	$ 200	$ 205	0,03
U.S. Treasury Inflation Protected Securities (d)			
0,125 % fällig am 15.04.2025	5.578	5.307	0,73
0,125 % fällig am 15.07.2031	2.942	2.610	0,36
0,125 % fällig am 15.01.2032	1.204	1.060	0,14
0,250 % fällig am 15.01.2025	6.019	5.770	0,79
0,500 % fällig am 15.01.2028	6.517	6.098	0,83
0,625 % fällig am 15.07.2032	418	384	0,05
1,125 % fällig am 15.01.2033	5.397	5.174	0,71
1,750 % fällig am 15.01.2028	579	573	0,08
2,375 % fällig am 15.01.2027	752	756	0,10
2,500 % fällig am 15.01.2029	5.086	5.240	0,72
3,875 % fällig am 15.04.2029	1.661	1.835	0,25
U.S. Treasury Notes			
3,500 % fällig am 15.02.2033	600	585	0,08
		35.846	4,90
Summe USA		347.969	47,63
KURZFRISTIGE INSTRUMENTE			
COMMERCIAL PAPER			
AT+T, Inc.			
5,700 % fällig am 19.03.2024	2.750	2.632	0,36
Electricite de France S.A.			
5,510 % fällig am 04.08.2023	1.300	1.293	0,18
Enel Finance America LLC			
5,450 % fällig am 06.07.2023	400	400	0,06

BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
5,450 % fällig am 24.07.2023	400	398	0,05
Global Payments, Inc.			
5,930 % fällig am 28.07.2023	$ 500	$ 498	0,07
		5.221	0,72
HUNGARY TREASURY BILLS			
16,220 % fällig am 06.07.2023 (b)(c)	HUF 608.000	1.775	0,24
ISRAEL TREASURY BILLS			
1,716 % fällig am 05.07.2023 (b)(c)	ILS 2.200	593	0,08
JAPAN TREASURY BILLS			
(0,202) % fällig am 18.07.2023 (b)(c)	¥5.730.000	39.646	5,43
(0,202) % fällig am 28.08.2023 (b)(c)	377.000	2.609	0,36
(0,200) % fällig am 24.07.2023 (b)(c)	3.250.000	22.488	3,08
(0,200) % fällig am 28.08.2023 (b)(c)	570.000	3.944	0,54
(0,197) % fällig am 31.07.2023 (b)(c)	397.000	2.747	0,37
(0,189) % fällig am 28.08.2023 (b)(c)	343.000	2.374	0,32
(0,184) % fällig am 04.09.2023 (b)(c)	6.390.000	44.219	6,06
(0,183) % fällig am 10.07.2023 (b)(c)	1.160.000	8.026	1,10
(0,178) % fällig am 31.07.2023 (b)(c)	¥ 113.000	$ 782	0,11

BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
(0,173) % fällig am 19.09.2023 (b)(c)	1.300.000	8.997	1,23
(0,172) % fällig am 19.09.2023 (b)(c)	430.000	2.976	0,41
		138.808	19,01
Summe kurzfristige Instrumente		146.397	20,05
Summe Übertragbare Wertpapiere		**$ 880.157**	**120,47**
	AKTIEN		
INVESTMENTFONDS			
ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN			
PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (e)	4.454.619	44.360	6,07
PIMCO Specialty Funds Ireland p.l.c. - PIMCO China Bond Fund (e)	402.852	5.249	0,72
		49.609	6,79
BÖRSENGEHANDELTE FONDS			
PIMCO ETFs plc - PIMCO Euro Short Maturity UCITS ETF (e)	4.450	471	0,06
Summe Investmentfonds		**$ 50.080**	**6,85**

PENSIONSGESCHÄFTE

Kontrahent	Kredit-zins	Abrechnungs-datum	Fälligkeits-datum	Kapital-betrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensions-geschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensions-geschäft[1]	% des Netto-vermögens
FICC	2,400 %	30.06.2023	03.07.2023	$ 1.874	U.S. Treasury Notes 4,625 % fällig am 30.06.2025	$ (1.911)	$ 1.874	$ 1.874	0,26
Summe Pensionsgeschäfte						**$ (1.911)**	**$ 1.874**	**$ 1.874**	**0,26**

[1] Umfasst aufgelaufene Zinsen.

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

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

FUTURES

Beschreibung	Art	Ablauf-monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
3-Month SOFR December Futures	Short	03.2024	171	$ 446	0,06
3-Month SOFR June Futures	Short	09.2024	73	26	0,00
3-Month SOFR March Futures	Long	06.2024	73	(16)	0,00
Australia Government 3-Year Note September Futures	Short	09.2023	56	22	0,00
Australia Government 10-Year Bond September Futures	Short	09.2023	62	25	0,00
Canada Government 10-Year Bond September Futures	Long	09.2023	26	(6)	0,00
Euro-Bobl September Futures	Short	09.2023	378	728	0,10
Euro-BTP Italy Government Bond September Futures	Long	09.2023	96	98	0,01
Euro-BTP Italy Government Bond September Futures	Short	09.2023	192	204	0,03
Euro-Bund 10-Year Bond September Futures	Short	09.2023	29	40	0,01
Euro-Buxl 30-Year Bond September Futures	Long	09.2023	15	33	0,00
Euro-OAT France Government 10-Year Bond September Futures	Short	09.2023	266	293	0,04
Euro-Schatz September Futures	Short	09.2023	98	22	0,00
Japan Government 10-Year Bond September Futures	Long	09.2023	32	130	0,02
U.S. Treasury 2-Year Note September Futures	Short	09.2023	47	138	0,02
U.S. Treasury 5-Year Note September Futures	Short	09.2023	410	851	0,12
U.S. Treasury 10-Year Note September Futures	Long	09.2023	22	(23)	0,00
U.S. Treasury 10-Year Ultra September Futures	Short	09.2023	79	107	0,02
U.S. Treasury 30-Year Bond September Futures	Long	09.2023	3	0	0,00
U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond September Futures	Short	09.2023	9	(18)	0,00
United Kingdom Long Gilt September Futures	Short	09.2023	117	150	0,02
				$ 3.250	0,45

VERKAUFSOPTIONEN

OPTIONEN AUF BÖRSENGEHANDELTE TERMINKONTRAKTE

Beschreibung	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Anzahl der Kontrakte	Aufgeld	Markt-wert	% des Nettovermögens
Put - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note August Futures	$ 111,500	21.07.2023	5	$ (2)	$ (2)	0,00
Call - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note August Futures	115,500	21.07.2023	5	(2)	0	0,00
Call - CME-Kaufoptionen mit Ausübungskurs bei 98,000 USD auf 3-Month SOFR December Futures	98,000	15.12.2023	13	(11)	(1)	0,00
Put - CME-Verkaufsoptionen mit Ausübungskurs bei 96,500 USD auf 3-Month SOFR December Futures	96,500	15.12.2023	13	(12)	(61)	(0,01)
				$ (27)	$ (64)	(0,01)
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate					**$ 3.186**	**0,44**

ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)

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

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMMISSIONEN - SCHUTZVERKAUF[1]

Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag[3]	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Ford Motor Credit Co. LLC	5,000 %	20.12.2024	$ 100	$ (1)	0,00
Jaguar Land Rover Automotive PLC	5,000	20.06.2026	€ 500	(28)	0,00
				$ (29)	0,00

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES - SCHUTZKAUF[2]

Index/Tranchen	Zu bezahlender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag[3]	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
CDX.IG-40 10-Year Index	(1,000) %	20.06.2033	$ 89.000	$ (977)	(0,13)
iTraxx Europe Main 39 10-Year Index	(1,000)	20.06.2033	€ 5.600	(78)	(0,01)
				$ (1.055)	(0,14)

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF[1]

Index/Tranchen	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag[3]	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
CDX.IG-39 5-Year Index	1,000 %	20.12.2027	$ 2.800	$ 23	0,00
CDX.IG-40 5-Year Index	1,000	20.06.2028	69.000	525	0,07
				$ 548	0,07

ZINSSWAPS

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Zahlung[4]	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	3,250 %	20.09.2053	£ 2.100	$ (195)	(0,03)
Zahlung[4]	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	3,500	20.09.2033	52.900	(2.643)	(0,36)
Zahlung[4]	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	3,750	20.09.2028	13.600	(868)	(0,12)
Zahlung[4]	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	4,000	20.09.2025	2.800	(103)	(0,01)
Erhalt	1-Day INR-MIBOR Compounded-OIS	6,250	16.03.2032	INR 116.100	(102)	(0,01)
Zahlung	1-Day INR-MIBOR Compounded-OIS	6,500	15.03.2028	182.510	18	0,00
Zahlung	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,000	15.12.2023	¥ 2.430.000	(24)	0,00
Zahlung	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,000	15.12.2026	970.000	24	0,00
Zahlung	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,000	15.12.2028	10.000	(1)	0,00
Zahlung	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,000	17.03.2031	610.000	(106)	(0,01)
Zahlung	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,050	15.12.2031	851.000	(10)	0,00
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,400	19.06.2039	540.000	335	0,05
Zahlung	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,400	15.12.2051	80.000	(74)	(0,01)
Zahlung	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,450	15.12.2051	170.000	47	0,01
Zahlung	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,800	15.06.2052	640.000	42	0,01
Zahlung	1-Day SGD-SIBCSORA Compounded-OIS	3,000	15.03.2028	SGD 5.920	(112)	(0,02)
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	0,000	15.07.2023	$ 24.600	333	0,04
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	0,000	25.08.2023	10.200	(142)	(0,02)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	0,000	31.08.2023	11.650	(162)	(0,02)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	0,000	15.09.2023	35.400	(494)	(0,07)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	0,400	15.01.2028	24.600	(2.812)	(0,39)
Erhalt[4]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	0,750	16.06.2031	15.710	1.989	0,27
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,000	15.06.2027	16.900	1.291	0,18
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,000	15.06.2029	26.260	(1.886)	(0,26)
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,249	31.08.2024	11.650	815	0,11
Erhalt[4]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,250	15.12.2026	28.000	2.983	0,41
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,250	15.12.2026	35.400	4.134	0,57
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,298	25.08.2024	10.200	729	0,10
Zahlung[4]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,500	15.12.2028	19.300	(2.561)	(0,35)
Zahlung[4]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,518	20.01.2029	1.500	(185)	(0,03)

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits-datum		Nenn-betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Zahlung[4]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,630 %	20.01.2029	$	4.400	$ (520)	(0,07)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,695	15.11.2031		30	(5)	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,750	15.06.2024		9.600	122	0,02
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,750	15.06.2027		21.830	112	0,01
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,750	15.06.2052		1.980	71	0,01
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,750	21.06.2053		2.010	11	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,906	16.09.2052		2.300	(152)	(0,02)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,965	30.06.2024		15.900	(366)	(0,05)
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,965	30.11.2026		27.900	1.404	0,19
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,968	30.06.2024		15.900	(366)	(0,05)
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,000	21.06.2033		3.400	67	0,01
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,000	21.06.2033		2.890	(1)	0,00
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,048	15.11.2032		10.200	479	0,07
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,050	08.09.2029		500	(22)	0,00
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,070	15.11.2032		4.000	179	0,02
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,083	15.11.2032		6.500	284	0,04
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,086	15.11.2032		4.700	157	0,02
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,089	15.11.2032		6.600	284	0,04
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,100	09.09.2029		2.100	(84)	(0,01)
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,106	15.11.2032		3.200	134	0,02
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,139	15.11.2032		4.500	176	0,02
Erhalt[4]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,150	13.05.2025		73.700	720	0,10
Zahlung[4]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,165	03.10.2053		1.000	3	0,00
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,173	15.11.2032		3.300	121	0,02
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,174	15.11.2032		3.500	127	0,02
Erhalt[4]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,200	13.05.2025		4.600	52	0,01
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,225	30.09.2029		2.800	(95)	(0,01)
Zahlung[4]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,240	03.10.2053		1.000	17	0,00
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,250	21.06.2028		4.800	77	0,01
Zahlung[4]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,250	20.12.2053		3.500	7	0,00
Erhalt[4]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,445	03.10.2038		3.200	1	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,454	30.06.2029		5.400	(96)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,470	22.02.2030		1.100	(18)	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,500	22.06.2030		1.800	(16)	0,00
Erhalt[4]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,500	20.12.2030		200	2	0,00
Erhalt[4]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,500	20.12.2033		2.462	(19)	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,525	02.03.2030		700	(10)	0,00
Erhalt[4]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,533	03.10.2038		3.200	(31)	0,00
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,750	21.06.2025		14.800	239	0,03
Erhalt[4]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,750	20.12.2028		17.007	147	0,02
Zahlung[4]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,752	03.10.2028		4.100	(6)	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,800	10.03.2028		1.200	(10)	0,00
Zahlung[4]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,850	03.10.2028		4.100	11	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,898	30.06.2029		5.000	29	0,00
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	4,159	31.03.2025		35.100	568	0,08
Erhalt[4]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	4,250	20.12.2025		58.651	311	0,04
Erhalt[4]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	4,409	04.10.2024		15.000	(189)	(0,03)
Erhalt[4]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	4,409	04.10.2024		15.000	196	0,03
Erhalt[4]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	4,789	07.03.2024		7.400	(60)	0,00
Erhalt[4]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	4,789	07.03.2024		7.400	33	0,00
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	1,220	03.03.2025	CAD	6.900	(414)	(0,06)
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	1,500	17.06.2025		9.600	(508)	(0,07)
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	1,500	17.06.2030		9.200	(819)	(0,11)
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	1,500	16.06.2051		250	(34)	(0,01)
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	1,713	02.10.2029		2.100	(192)	(0,03)
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	1,900	18.12.2029		24.500	(2.226)	(0,31)
Erhalt	3-Month CAD-Bank Bill	3,250	15.03.2028		9.640	346	0,05
Erhalt	3-Month CAD-Bank Bill	3,250	15.03.2033		4.900	178	0,02
Zahlung	3-Month CAD-CAONREPO Compounded-OIS	3,250	21.06.2033		9.500	41	0,01
Zahlung[4]	3-Month CAD-CAONREPO Compounded-OIS	3,500	10.05.2025		101.700	(623)	(0,09)
Zahlung	3-Month CHF-SRFXON3 Compounded-OIS	0,283	14.02.2027	CHF	900	(61)	(0,01)
Zahlung	3-Month CHF-SRFXON3 Compounded-OIS	0,294	10.02.2027		8.500	(550)	(0,08)
Zahlung	3-Month CHF-SRFXON3 Compounded-OIS	0,343	16.05.2027		1.900	(125)	(0,02)
Zahlung	3-Month CNY-CNREPOFIX	2,500	16.03.2027	CNY	61.000	123	0,02
Zahlung	3-Month CNY-CNREPOFIX	2,500	21.12.2027		90.900	216	0,03
Zahlung	3-Month CNY-CNREPOFIX	2,750	21.06.2028		64.900	32	0,00
Zahlung	3-Month EUR-ESTRON Compounded-OIS	1,000	23.11.2024	€	17.300	(320)	(0,04)
Zahlung	3-Month KRW-KORIBOR	3,250	15.03.2028	KRW	40.562.187	(577)	(0,08)
Erhalt	3-Month KRW-KORIBOR	3,250	15.03.2033		3.184.165	7	0,00
Erhalt[4]	3-Month KRW-KORIBOR	3,250	20.09.2033		4.463.160	10	0,00
Zahlung	3-Month NZD-BBR	0,528	17.03.2024	NZD	650	(12)	0,00
Zahlung	3-Month NZD-BBR	3,750	15.06.2027		9.400	(124)	(0,02)
Zahlung	3-Month NZD-BBR	4,000	14.06.2024		32.500	(284)	(0,04)
Zahlung[4]	3-Month NZD-BBR	4,750	20.03.2025		22.600	(78)	(0,01)
Zahlung[4]	3-Month NZD-BBR	5,000	20.03.2025		24.900	(29)	0,00
Zahlung	3-Month SEK-STIBOR	0,500	19.06.2024	SEK	56.200	(257)	(0,04)
Erhalt	3-Month THB-THORON Compounded-OIS	2,250	15.03.2028	THB	108.160	36	0,01
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	0,000	15.07.2023	$	24.600	(330)	(0,05)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	0,000	25.08.2023		10.200	141	0,02
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	0,000	31.08.2023		11.650	163	0,02
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	0,000	15.09.2023		35.400	502	0,07

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits-datum		Nenn-betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	0,750 %	16.09.2023	$	15.710	$ 196	0,03
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,250	15.09.2023		28.000	310	0,04
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,500	15.09.2023		19.300	(201)	(0,03)
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,518	20.07.2023		1.500	(9)	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,630	20.07.2023		4.400	(23)	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	4,409	04.07.2023		15.000	32	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	4,409	04.07.2023		15.000	(32)	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	4,789	07.07.2023		7.400	(2)	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	4,789	07.09.2023		7.400	16	0,00
Erhalt	6-Month AUD-BBR-BBSW	1,250	17.06.2030	AUD	5.100	504	0,07
Zahlung	6-Month AUD-BBR-BBSW	1,750	16.03.2027		6.600	(397)	(0,05)
Zahlung	6-Month AUD-BBR-BBSW	4,000	21.06.2033		7.900	(219)	(0,03)
Zahlung[4]	6-Month AUD-BBR-BBSW	4,250	15.09.2032		1.900	(8)	0,00
Zahlung	6-Month AUD-BBR-BBSW	4,250	15.03.2033		17.700	(448)	(0,06)
Zahlung[4]	6-Month AUD-BBR-BBSW	4,500	15.09.2032		39.100	81	0,01
Zahlung	6-Month CZK-PRIBOR	1,913	30.01.2029	CZK	24.300	(164)	(0,02)
Erhalt[4]	6-Month EUR-EURIBOR	0,054	27.05.2050	€	450	116	0,02
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	0,064	17.11.2052		1.000	356	0,05
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	0,550	10.08.2024		900	(40)	(0,01)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	0,650	12.04.2027		2.400	(255)	(0,04)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	0,650	11.05.2027		1.800	(187)	(0,03)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	0,700	11.04.2027		1.400	(147)	(0,02)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	1,000	13.05.2027		2.200	(206)	(0,03)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	1,000	18.05.2027		1.300	(122)	(0,02)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,100	11.04.2024		6.500	(102)	(0,01)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,100	13.04.2024		14.700	(230)	(0,03)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,100	17.05.2024		4.000	(68)	(0,01)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,250	26.04.2024		1.600	(22)	0,00
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,250	28.04.2024		2.200	(33)	0,00
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,250	03.05.2024		2.100	(31)	0,00
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,250	21.09.2037		8.950	(827)	(0,11)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,250	21.09.2042		1.260	(200)	(0,03)
Erhalt[4]	6-Month EUR-EURIBOR	2,500	20.09.2053		21.200	(153)	(0,02)
Zahlung[4]	6-Month EUR-EURIBOR	3,000	19.03.2027		30.530	(203)	(0,03)
Zahlung[4]	6-Month EUR-EURIBOR	3,000	20.09.2028		121.700	(285)	(0,04)
Erhalt[4]	6-Month EUR-EURIBOR	3,000	15.03.2033		13.460	(39)	(0,01)
Zahlung[4]	6-Month EUR-EURIBOR	3,000	20.09.2033		107.000	229	0,03
Zahlung[4]	6-Month EUR-EURIBOR	3,500	20.09.2025		38.200	(260)	(0,04)
Zahlung	6-Month HUF-BBR	1,500	20.03.2024	HUF	342.600	(113)	(0,02)
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	4,870	07.07.2025	MXN	86.100	(247)	(0,03)
						$ (4.866)	(0,67)
Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate						**$ (5.402)**	**(0,74)**

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

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

(3) Der maximal mögliche Betrag, den der Fonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

(4) Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft.

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

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

OPTIONSKAUF

ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag[1]	Kosten	Markt-wert	% des Nettovermögens
BOA	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,180 %	11.01.2024	3.600	$ 103	$ 369	0,05

OPTIONEN AUF WERTPAPIERE

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag[1]	Kosten	Markt-wert	% des Nettovermögens
BPS	Put - OTC France Government International Bond 0,750 % fällig am 25.05.2052	€ 97,000	23.05.2025	1.600	$ 121	$ 668	0,09

VERKAUFSOPTIONEN

ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag[1]	Aufgeld	Markt-wert	% des Nettovermö-gens
BOA	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,150 %	01.12.2023	1.900	$ (6)	$ 0	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,650	01.12.2023	1.900	(6)	(26)	(0,01)
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,310	11.01.2024	31.500	(102)	(762)	(0,11)
	Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,070	10.07.2023	600	(4)	(2)	0,00
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,370	10.07.2023	600	(4)	(1)	0,00
	Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,060	14.07.2023	400	(3)	(2)	0,00
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,360	14.07.2023	400	(3)	(1)	0,00
BPS	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,200	06.07.2023	360	(1)	0	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,650	06.07.2023	360	(1)	0	0,00
	Put - OTC 25-Year Interest Rate Swap	6-Month EUR-EURIBOR	Zahlung	0,451	23.05.2025	1.600	(121)	(613)	(0,09)
	Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,000	03.07.2023	600	(4)	0	0,00
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,400	03.07.2023	600	(4)	0	0,00
DUB	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,920	13.10.2023	1.100	(7)	0	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,920	13.10.2023	1.100	(7)	(24)	0,00
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,790	08.04.2024	2.800	(22)	(4)	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,790	08.04.2024	2.800	(22)	(49)	(0,01)
GLM	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,920	13.10.2023	800	(5)	0	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,920	13.10.2023	800	(5)	(17)	0,00
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,018	20.10.2023	800	(5)	0	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,018	20.10.2023	800	(5)	(16)	0,00
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,140	23.10.2023	900	(6)	0	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,140	23.10.2023	900	(6)	(17)	0,00
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,190	23.10.2023	800	(5)	0	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,190	23.10.2023	800	(6)	(15)	0,00
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,225	23.10.2023	900	(6)	0	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,225	23.10.2023	900	(6)	(17)	0,00
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,973	25.10.2023	1.100	(8)	0	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,973	25.10.2023	1.100	(8)	(23)	0,00
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,841	27.10.2023	800	(5)	0	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,841	27.10.2023	800	(5)	(17)	0,00
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,088	03.11.2023	500	(4)	0	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,088	03.11.2023	500	(4)	(10)	0,00
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,910	10.11.2023	1.700	(11)	0	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,910	10.11.2023	1.700	(11)	(35)	(0,01)
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,250	17.11.2023	3.000	(11)	0	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,750	17.11.2023	3.000	(11)	(39)	(0,01)
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,150	20.11.2023	1.500	(5)	0	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,650	20.11.2023	1.500	(5)	(21)	0,00
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,250	07.12.2023	1.400	(4)	0	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,750	07.12.2023	1.400	(4)	(18)	0,00
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,697	02.04.2024	3.400	(27)	(4)	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,697	02.04.2024	3.400	(27)	(62)	(0,01)
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,721	08.04.2024	900	(7)	(1)	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,721	08.04.2024	900	(7)	(16)	0,00
JPM	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	6-Month GBP-LIBOR	Erhalt	0,820	16.12.2024	8.700	(61)	(9)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,300	10.07.2023	400	(1)	0	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,750	10.07.2023	400	(1)	0	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,250	20.07.2023	1.200	(4)	(2)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,650	20.07.2023	1.200	(4)	(5)	0,00
MYC	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,993	11.10.2023	700	(5)	0	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,993	11.10.2023	700	(5)	(15)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,200	06.07.2023	340	(1)	0	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,650	06.07.2023	340	(1)	0	0,00
							$ (619)	$ (1.843)	(0,25)

[1] Der Nennbetrag stellt die Anzahl der Kontrakte dar.

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMMISSIONEN - SCHUTZVERKAUF[1]

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag[2]	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Markt-wert	% des Nettovermö-gens
BRC	Italy Government International Bond	1,000 %	20.06.2025	$ 1.500	$ (37)	$ 55	$ 18	0,00
CBK	Italy Government International Bond	1,000	20.06.2025	1.000	(24)	36	12	0,00
					$ (61)	$ 91	$ 30	0,00

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

[2] Der maximal mögliche Betrag, den der Fonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

CROSS-CURRENCY SWAPS

Kontrahent	Erhalt	Zahlung	Fälligkeits-datum	Nennbetrag erhaltener Währung	Nennbetrag gelieferter Währung	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Markt-wert	% des Nettovermögens
AZD	Variabler Zinssatz entspricht 3-Month AUD-LIBOR zzgl. 0,290 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung	Variabler Zinssatz entspricht 3-Month USD-LIBOR basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung	04.01.2031	AUD 5.900	$ 4.445	$ 29	$ (17)	$ 12	0,00
CBK	Variabler Zinssatz entspricht 3-Month AUD-LIBOR zzgl. 0,420 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung	Variabler Zinssatz entspricht 3-Month USD-LIBOR basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung	31.07.2029	7.100	4.899	(2)	11	9	0,00
GLM	Variabler Zinssatz entspricht 3-Month AUD-LIBOR zzgl. 0,423 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung	Variabler Zinssatz entspricht 3-Month USD-LIBOR basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung	01.08.2029	7.000	4.830	(14)	12	(2)	0,00
MYC	Variabler Zinssatz entspricht 3-Month AUD-LIBOR zzgl. 0,298 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung	Variabler Zinssatz entspricht 3-Month USD-LIBOR basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung	14.10.2030	2.000	1.437	9	(5)	4	0,00
						$ 22	$ 1	$ 23	0,00

ZINSSWAPS

Kontrahent	Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Markt-wert	% des Nettovermö-gens
BOA	Erhalt	3-Month MYR-KLIBOR	3,500 %	15.03.2028	MYR 33.519	$ (13)	$ 63	$ 50	0,01
	Erhalt	3-Month MYR-KLIBOR	3,750	15.03.2033	8.180	(2)	20	18	0,00
BPS	Erhalt	3-Month MYR-KLIBOR	3,500	15.03.2028	7.817	(3)	15	12	0,00
GLM	Erhalt	3-Month MYR-KLIBOR	3,545	05.05.2028	8.126	0	10	10	0,00
	Erhalt	3-Month MYR-KLIBOR	3,635	05.04.2024	10.508	(3)	2	(1)	0,00
	Erhalt	3-Month MYR-KLIBOR	3,750	15.03.2033	3.483	7	1	8	0,00
GST	Erhalt	3-Month MYR-KLIBOR	3,500	15.03.2028	17.760	(6)	32	26	0,01
SCX	Erhalt	3-Month MYR-KLIBOR	3,750	15.03.2028	4.750	(14)	10	(4)	0,00
						$ (34)	$ 153	$ 119	0,02

TOTAL RETURN SWAPS AUF INDIZES

Kontrahent	Zahlung/Erhalt	Wertpapier	Anzahl der Anteile oder Einheiten	Variabler Zinssatz	Nenn-betrag	Fälligkeits-datum	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Markt-wert	% des Nettovermö-gens
BOA	Erhalt	iBoxx USD Liquid Investment Grade Index	k. A.	1,084 %	$ 5.400	20.09.2023	$ 42	$ (60)	$ (18)	0,00
BPS	Erhalt	iBoxx USD Liquid Investment Grade Index	k. A.	1,084	4.645	20.09.2023	36	(72)	(36)	(0,01)
	Erhalt	iBoxx USD Liquid High Yield Index	k. A.	1,084	14.200	20.03.2024	169	(279)	(110)	(0,01)
MYC	Erhalt	iBoxx USD Liquid High Yield Index	k. A.	1,084	1.700	20.03.2024	21	(21)	0	0,00
							$ 268	$ (432)	$ (164)	(0,02)

DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung		Zu erhaltende Währung		Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
AZD	07.2023	AUD	337	$	220	$ 0	$ (4)	$ (4)	0,00
	07.2023	$	1.015	AUD	1.530	3	0	3	0,00
	08.2023	AUD	1.530	$	1.016	0	(3)	(3)	0,00
BOA	07.2023		2.708		1.768	0	(34)	(34)	0,00
	07.2023	CAD	8.047		5.914	0	(167)	(167)	(0,02)
	07.2023	DKK	29.635		4.279	0	(63)	(63)	(0,01)
	07.2023	NZD	1.606		974	0	(10)	(10)	0,00
	07.2023	$	7.912	DKK	53.792	0	(30)	(30)	0,00
	07.2023		522	€	478	0	(1)	(1)	0,00
	07.2023		1.789	£	1.415	9	0	9	0,00
	07.2023		3.752	NOK	41.246	98	0	98	0,01
	07.2023		184	PEN	673	2	0	2	0,00
	08.2023	CNH	23.387	$	3.342	117	0	117	0,02
	08.2023	DKK	53.703		7.912	30	0	30	0,00
	08.2023	¥	828.579		6.009	229	0	229	0,03
	09.2023	CLP	502.008		614	0	(6)	(6)	0,00
	09.2023	IDR	136.167		9	0	0	0	0,00
	09.2023	¥	8.120.000		59.097	2.353	0	2.353	0,32
	09.2023	KRW	5.070.228		4.002	138	0	138	0,02
	09.2023	TWD	83.288		2.744	64	0	64	0,01
	09.2023	$	1.667	INR	137.917	9	0	9	0,00
	09.2023		455	PEN	1.669	3	0	3	0,00

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung		Zu erhaltende Währung		Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BPS	07.2023	CAD	877	$	656	$ 0	$ (7)	$ (7)	0,00
	07.2023	DKK	105		15	0	0	0	0,00
	07.2023	€	1.215		1.331	5	0	5	0,00
	07.2023	ILS	1.057		332	47	0	47	0,01
	07.2023	¥	2.102.167		15.131	586	0	586	0,08
	07.2023	MYR	7.458		1.625	24	0	24	0,00
	07.2023	NOK	9.647		897	0	(3)	(3)	0,00
	07.2023	$	724	AUD	1.094	4	0	4	0,00
	07.2023		130.741	€	119.313	1	(571)	(570)	(0,08)
	08.2023	AUD	1.094	$	725	0	(4)	(4)	0,00
	08.2023	CNH	102.230		14.670	570	0	570	0,08
	08.2023	€	115.147		126.344	546	0	546	0,07
	08.2023	TWD	41.688		1.365	27	0	27	0,00
	08.2023	$	897	NOK	9.637	3	0	3	0,00
	09.2023	THB	4	$	0	0	0	0	0,00
BRC	07.2023	£	523		649	0	(16)	(16)	0,00
	07.2023	¥	5.730.000		44.301	4.580	0	4.580	0,63
	07.2023	$	792	£	640	22	0	22	0,00
	09.2023	IDR	41.220	$	3	0	0	0	0,00
	09.2023	ILS	2.793		781	26	0	26	0,00
	09.2023	$	145	PEN	532	1	0	1	0,00
	04.2024	¥	690.018	$	5.644	656	0	656	0,09
	05.2024		310.000		2.507	256	0	256	0,03
BSH	07.2023	$	572	PEN	2.107	8	0	8	0,00
CBK	07.2023	AUD	1.169	$	763	0	(15)	(15)	0,00
	07.2023	ILS	6.406		1.894	167	0	167	0,02
	07.2023	NZD	1.289		791	1	0	1	0,00
	07.2023	$	630	CLP	509.551	5	0	5	0,00
	07.2023		2.121	€	1.969	28	(1)	27	0,00
	07.2023		1.112	£	875	0	0	0	0,00
	07.2023		160	NOK	1.796	8	0	8	0,00
	07.2023		833	PEN	3.052	8	0	8	0,00
	08.2023	¥	461.421	$	3.348	129	0	129	0,02
	08.2023	TWD	43.402		1.422	28	0	28	0,00
	08.2023	$	217	CNH	1.496	0	(11)	(11)	0,00
	09.2023	CNH	15.978	$	2.242	32	0	32	0,00
	09.2023	$	39	KRW	49.702	0	(1)	(1)	0,00
	09.2023		2.363	THB	81.767	3	(42)	(39)	(0,01)
	10.2023		2	CLP	1.914	0	0	0	0,00
	11.2023	ILS	10.830	$	3.236	298	0	298	0,04
CLY	07.2023	DKK	87.094		12.571	0	(190)	(190)	(0,03)
	08.2023	CNH	4.097		578	13	0	13	0,00
DUB	07.2023	ILS	7.554		2.157	120	0	120	0,02
	07.2023	$	3.613	BRL	19.578	445	0	445	0,06
	09.2023		167	PEN	612	1	0	1	0,00
GLM	07.2023	BRL	17.840	$	3.695	0	(3)	(3)	0,00
	07.2023	NOK	59.496		5.520	0	(33)	(33)	0,00
	07.2023	PEN	3.826		1.048	0	(7)	(7)	0,00
	08.2023	CNH	13.283		1.903	70	0	70	0,01
	08.2023	$	5.520	NOK	59.438	34	0	34	0,00
	08.2023		472	PEN	1.722	1	0	1	0,00
	09.2023		3.695	BRL	18.038	3	0	3	0,00
	09.2023		576	PEN	2.119	5	0	5	0,00
	09.2023		3.364	SGD	4.498	0	(31)	(31)	0,00
	09.2023		1	THB	34	0	0	0	0,00
JPM	07.2023	AUD	2.602	$	1.701	0	(31)	(31)	0,00
	07.2023	KRW	11.031.641		8.641	262	0	262	0,04
	07.2023	SGD	1.107		838	20	0	20	0,00
	07.2023	$	4.758	¥	680.400	0	(50)	(50)	(0,01)
	08.2023	CNH	53.553	$	7.745	359	0	359	0,05
	08.2023	¥	677.508		4.758	50	0	50	0,01
	08.2023	$	84	HUF	28.991	0	0	0	0,00
	09.2023	IDR	56.949	$	4	0	0	0	0,00
	09.2023	ILS	2.680		754	30	0	30	0,00
	09.2023	PEN	13.317		3.617	0	(35)	(35)	0,00
	09.2023	$	1	IDR	12.251	0	0	0	0,00
	09.2023		198	INR	16.355	0	0	0	0,00
	09.2023		746	THB	25.578	0	(19)	(19)	0,00
	12.2023		3.625	INR	299.140	0	(1)	(1)	0,00
	10.2024	¥	330.000	$	2.646	199	0	199	0,03
MBC	07.2023	€	1.805		1.939	0	(30)	(30)	0,00
	07.2023	£	34.946		43.387	23	(1.065)	(1.042)	(0,14)
	07.2023	¥	3.250.000		24.885	2.336	0	2.336	0,32
	07.2023	SGD	63		47	0	0	0	0,00
	07.2023	$	3.027	CAD	4.013	10	(5)	5	0,00
	07.2023		1.574	€	1.467	26	0	26	0,00
	07.2023		2.461	£	1.975	50	0	50	0,01
	07.2023		735	¥	104.200	0	(14)	(14)	0,00
	08.2023	TWD	13.635	$	440	2	0	2	0,00
	09.2023	KRW	9.398.733		7.370	207	0	207	0,03
	03.2024	¥	620.016		5.070	610	0	610	0,08
	10.2024		730.000		5.853	439	0	439	0,06

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung		Zu erhaltende Währung		Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
MYI	07.2023	£	920	$	1.143	$ 0	$ (26)	$ (26)	0,00
	07.2023	IDR	35.891		2	0	0	0	0,00
	07.2023	NZD	107		65	0	(1)	(1)	0,00
	07.2023	$	1.415	AUD	2.114	0	(8)	(8)	0,00
	07.2023		7.033	DKK	47.973	0	(4)	(4)	0,00
	07.2023		2	IDR	35.891	0	0	0	0,00
	08.2023	DKK	47.893	$	7.033	4	0	4	0,00
	08.2023	TWD	56.185		1.851	46	0	46	0,01
	09.2023	IDR	35.922		2	0	0	0	0,00
	09.2023	KRW	10.562.658		8.254	204	0	204	0,03
	09.2023	$	849	IDR	12.681.287	0	(7)	(7)	0,00
	09.2023		43	INR	3.533	0	0	0	0,00
	09.2023		341	THB	11.659	0	(9)	(9)	0,00
	10.2024	¥	260.000	$	2.126	198	0	198	0,03
RBC	07.2023	$	783	CAD	1.050	10	0	10	0,00
	07.2023		61	MXN	1.172	7	0	7	0,00
	08.2023	MXN	2.340	$	135	0	0	0	0,00
RYL	04.2024	DKK	7.300		1.096	8	0	8	0,00
SCX	07.2023	AUD	3.672		2.400	0	(45)	(45)	(0,01)
	07.2023	MYR	7.459		1.623	22	0	22	0,00
	07.2023	NZD	4.183		2.540	0	(23)	(23)	0,00
	07.2023	$	1.492	AUD	2.247	4	0	4	0,00
	08.2023	AUD	2.247	$	1.493	0	(4)	(4)	0,00
	08.2023	CNH	120.329		17.518	923	0	923	0,13
	08.2023	TWD	8.929		292	6	0	6	0,00
	09.2023	CNH	3.589		503	7	0	7	0,00
	09.2023	TWD	69.614		2.283	43	0	43	0,01
	09.2023	$	1.845	IDR	27.573.000	0	(13)	(13)	0,00
	09.2023		124	INR	10.229	0	0	0	0,00
	09.2023		1.523	KRW	1.940.075	0	(44)	(44)	(0,01)
	09.2023		308	PEN	1.138	4	0	4	0,00
	09.2023		1.586	THB	54.723	0	(31)	(31)	0,00
SOG	07.2023	AUD	2.223	$	1.455	0	(25)	(25)	0,00
	07.2023	€	120.207		129.311	0	(1.835)	(1.835)	(0,25)
SSB	07.2023	CLP	510.282		635	0	0	0	0,00
	07.2023	¥	510.000		3.867	325	0	325	0,04
	08.2023	$	635	CLP	511.755	0	0	0	0,00
	09.2023	KRW	4.702.968	$	3.626	42	0	42	0,01
TOR	07.2023	AUD	1.176		769	0	(14)	(14)	0,00
	07.2023	$	1.826	AUD	2.765	14	0	14	0,00
	07.2023		2.918	CAD	3.862	2	(2)	0	0,00
	07.2023		40.007	£	31.484	20	0	20	0,00
	07.2023		9.149	¥	1.317.476	0	(34)	(34)	0,00
	07.2023		4.376	NZD	7.185	26	0	26	0,00
	08.2023	AUD	2.765	$	1.828	0	(14)	(14)	0,00
	08.2023	CAD	3.860		2.918	2	(2)	0	0,00
	08.2023	£	31.484		40.015	0	(20)	(20)	0,00
	08.2023	¥	1.311.888		9.149	34	0	34	0,00
	08.2023	NZD	7.185		4.375	0	(26)	(26)	0,00
UAG	07.2023	AUD	269		176	0	(3)	(3)	0,00
	07.2023	BRL	1.794		364	0	(8)	(8)	0,00
	07.2023	¥	1.160.000		8.849	817	0	817	0,11
	07.2023	$	2.943	AUD	4.407	6	(15)	(9)	0,00
	07.2023		2.607	NOK	28.851	86	0	86	0,01
	08.2023	AUD	4.407	$	2.945	15	(6)	9	0,00
	09.2023	CNH	4.818	THB	23.334	0	(3)	(3)	0,00
	09.2023	ILS	2.319	$	648	21	0	21	0,00
	09.2023	SGD	4.075		3.049	29	0	29	0,00
	09.2023	$	1.578	INR	130.474	8	0	8	0,00
						$ 19.372	$ (4.725)	$ 14.647	2,01

ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklasse Institutional EUR (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung		Zu erhaltende Währung		Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2023	€	1	$	1	$ 0	$ 0	$ 0	0,00
	07.2023	$	7.823	€	7.279	118	0	118	0,02
BPS	07.2023	€	7.560	$	8.284	36	0	36	0,00
	07.2023	$	7.938	€	7.382	116	0	116	0,02
	08.2023		8.295		7.560	0	(36)	(36)	(0,01)
CBK	07.2023	€	7.476	$	8.128	0	(28)	(28)	0,00
	07.2023	$	589	€	545	6	0	6	0,00
	08.2023		8.140		7.476	28	0	28	0,00
JPM	07.2023	€	7.559	$	8.254	7	0	7	0,00
	08.2023	$	8.265	€	7.559	0	(7)	(7)	0,00
MBC	07.2023	€	15	$	16	0	0	0	0,00
	07.2023	$	148	€	139	3	0	3	0,00
SOG	07.2023		7.817		7.266	111	0	111	0,02
						$ 425	$ (71)	$ 354	0,05

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklasse E Class USD (Currency Exposure) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung		Zu erhaltende Währung		Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
AZD	07.2023	AUD	289	$	192	$ 0	$ (1)	$ (1)	0,00
	07.2023	$	105	AUD	161	2	0	2	0,00
	08.2023		192		289	1	0	1	0,00
BOA	07.2023	CLP	38.151	$	47	0	0	0	0,00
	07.2023	DKK	706		104	0	0	0	0,00
	07.2023	PEN	278		77	0	0	0	0,00
	07.2023	SEK	4.274		396	0	0	0	0,00
	07.2023	THB	12.906		363	0	(1)	(1)	0,00
	07.2023	$	419	AUD	643	9	0	9	0,00
	07.2023		2.908	CAD	3.957	82	0	82	0,01
	07.2023		47	CLP	38.151	1	0	1	0,00
	07.2023		221	DKK	1.528	3	0	3	0,00
	07.2023		4.250	€	3.955	64	0	64	0,01
	07.2023		117	HUF	40.985	2	0	2	0,00
	07.2023		60	¥	8.358	0	(2)	(2)	0,00
	07.2023		4	KRW	5.019	0	0	0	0,00
	07.2023		57	NOK	631	1	0	1	0,00
	07.2023		51	NZD	84	1	0	1	0,00
	07.2023		75	PEN	278	2	0	2	0,00
	07.2023		3	SEK	29	0	0	0	0,00
	08.2023	CNY	725	$	100	0	0	0	0,00
	08.2023	$	47	CLP	38.151	0	0	0	0,00
	08.2023		104	DKK	705	0	0	0	0,00
	08.2023		76	PEN	278	0	0	0	0,00
	08.2023		396	SEK	4.269	0	0	0	0,00
	08.2023		364	THB	12.906	1	0	1	0,00
BPS	07.2023	AUD	96	$	63	0	(1)	(1)	0,00
	07.2023	CHF	489		547	0	0	0	0,00
	07.2023	CNY	66.515		9.207	42	0	42	0,01
	07.2023	€	17.592		19.276	84	0	84	0,01
	07.2023	NOK	154		14	0	0	0	0,00
	07.2023	TWD	475		16	0	0	0	0,00
	07.2023	$	3	CHF	2	0	0	0	0,00
	07.2023		161	CZK	3.542	2	0	2	0,00
	07.2023		18.791	€	17.479	281	0	281	0,04
	07.2023		12.304	¥	1.710.247	0	(472)	(472)	(0,07)
	07.2023		5	NZD	8	0	0	0	0,00
	08.2023		547	CHF	488	0	0	0	0,00
	08.2023		9.207	CNY	66.421	0	(24)	(24)	0,00
	08.2023		19.259	€	17.552	0	(84)	(84)	(0,01)
	08.2023		14	NOK	154	0	0	0	0,00
BRC	07.2023	KRW	1.517.793	$	1.150	0	(2)	(2)	0,00
	07.2023	$	196	PLN	827	8	0	8	0,00
	08.2023		1.150	KRW	1.515.884	2	0	2	0,00
CBK	07.2023	€	3.842	$	4.174	0	(18)	(18)	0,00
	07.2023	ILS	403		111	2	0	2	0,00
	07.2023	MXN	5.932		345	0	(1)	(1)	0,00
	07.2023	$	182	AUD	278	4	0	4	0,00
	07.2023		185	CNY	1.316	0	(4)	(4)	0,00
	07.2023		330	MXN	5.932	16	0	16	0,00
	07.2023		5	NOK	56	0	0	0	0,00
	07.2023		15	TWD	476	0	0	0	0,00
	08.2023	TWD	476	$	15	0	0	0	0,00
	08.2023	$	3.915	€	3.596	14	0	14	0,00
	08.2023		111	ILS	402	0	(3)	(3)	0,00
	08.2023		343	MXN	5.932	1	0	1	0,00
GLM	07.2023	NOK	950	$	88	0	(1)	(1)	0,00
	07.2023	$	412	MYR	1.847	0	(16)	(16)	0,00
	07.2023		374	THB	12.906	0	(10)	(10)	0,00
	08.2023		88	NOK	950	1	0	1	0,00
MBC	07.2023	£	121	$	151	0	(3)	(3)	0,00
	07.2023	$	2	CAD	2	0	0	0	0,00
	07.2023		64	CNY	456	0	(1)	(1)	0,00
	07.2023		4.201	£	3.394	115	0	115	0,01
	07.2023		5	SEK	54	0	0	0	0,00
	07.2023		246	SGD	332	0	0	0	0,00
MYI	07.2023	CZK	3.547	$	163	1	0	1	0,00
	07.2023	DKK	630		92	0	0	0	0,00
	07.2023	IDR	7.012.427		465	0	(2)	(2)	0,00
	07.2023	MYR	1.847		398	2	0	2	0,00
	07.2023	PLN	827		204	1	0	1	0,00
	07.2023	SGD	344		255	0	0	0	0,00
	07.2023	$	4	CHF	4	0	0	0	0,00
	07.2023		1	DKK	5	0	0	0	0,00
	07.2023		108	ILS	402	0	0	0	0,00
	07.2023		390	SEK	4.186	0	(2)	(2)	0,00
	08.2023		163	CZK	3.551	0	(1)	(1)	0,00
	08.2023		92	DKK	629	0	0	0	0,00
	08.2023		465	IDR	7.015.079	1	0	1	0,00
	08.2023		399	MYR	1.847	0	(2)	(2)	0,00
	08.2023		204	PLN	829	0	(1)	(1)	0,00
	08.2023		255	SGD	344	0	0	0	0,00

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung		Zu erhaltende Währung		Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
RBC	07.2023	CNY	280	$	39	$ 1	$ 0	$ 1	0,00
SCX	07.2023	AUD	425		282	0	(1)	(1)	0,00
	07.2023	IDR	9.895		1	0	0	0	0,00
	07.2023	$	390	AUD	597	7	0	7	0,00
	07.2023		530	CHF	476	2	0	2	0,00
	07.2023		133	NZD	220	1	0	1	0,00
	08.2023		282	AUD	425	1	0	1	0,00
TOR	07.2023	AUD	522	$	345	0	(3)	(3)	0,00
	07.2023	CAD	2.806		2.114	0	(6)	(6)	0,00
	07.2023	£	3.272		4.158	0	(2)	(2)	0,00
	07.2023	HUF	41.067		122	1	0	1	0,00
	07.2023	NZD	312		190	0	(1)	(1)	0,00
	07.2023	$	368	AUD	563	7	0	7	0,00
	08.2023		345		522	3	0	3	0,00
	08.2023		2.114	CAD	2.805	6	0	6	0,00
	08.2023		4.159	£	3.272	2	0	2	0,00
	08.2023		122	HUF	41.377	0	(1)	(1)	0,00
	08.2023		190	NZD	312	1	0	1	0,00
UAG	07.2023	AUD	1.039	$	693	3	(2)	1	0,00
	07.2023	CHF	24		27	0	0	0	0,00
	07.2023	$	84	AUD	129	1	0	1	0,00
	07.2023		35	CHF	31	0	0	0	0,00
	07.2023		9.275	CNY	65.202	0	(292)	(292)	(0,04)
	07.2023		0	CZK	5	0	0	0	0,00
	07.2023		465	IDR	6.985.798	0	0	0	0,00
	07.2023		1.145	KRW	1.510.095	1	0	1	0,00
	07.2023		42	NOK	461	1	0	1	0,00
	07.2023		22	SGD	29	0	0	0	0,00
	08.2023		693	AUD	1.039	2	(3)	(1)	0,00
	08.2023		27	CHF	24	0	0	0	0,00
						$ 786	$ (963)	$ (177)	(0,03)
Summe Freiverkehrsfinanzderivate								**$ 14.026**	**1,92**

LEERVERKAUFTE WERTPAPIERE

BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
US-REGIERUNGSBEHÖRDEN			
Uniform Mortgage-Backed Security, TBA			
2,000 % fällig am 01.07.2038	$ 13.300	$ (11.787)	(1,61)
2,000 % fällig am 01.08.2053	75.650	(61.800)	(8,46)
2,500 % fällig am 01.07.2053	3.300	(2.799)	(0,38)
3,000 % fällig am 01.08.2053	2.700	(2.380)	(0,33)
Summe Leerverkaufte Wertpapiere		**$ (78.766)**	**(10,78)**
Summe Anlagen		**$ 865.155**	**118,42**
Sonstige Aktiva und Passiva		**$ (134.579)**	**(18,42)**
Nettovermögen		**$ 730.576**	**100,00**

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

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

^ Das Wertpapier ist in Verzug.

(a) Bei dem Wertpapier handelt es sich um ein Interest Only- („IO“) bzw. IO-Strip.

(b) Nullkuponwertpapier.

(c) Der Kupon stellt eine Rendite bis zur Endfälligkeit dar.

(d) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

(e) Mit dem Fonds verbunden.

(f) Bedingt wandelbares Wertpapier.

(g) Eingeschränkte Wertpapiere (31. Dezember 2022: 0,76 %):

Emittentenbeschreibung	Kupon	Fälligkeits-datum	Kauf-datum	Kosten	Markt-wert	% des Nettovermögens
Citigroup, Inc.	3,290 %	17.03.2026	10.03.2022	$ 2.200	$ 2.105	0,29
Deutsche Bank AG	3,729	14.01.2032	22.01.2021	301	227	0,03
				$ 2.501	$ 2.332	0,32

Barmittel in Höhe von 25.310 USD (31. Dezember 2022: 25.647 USD) wurden zum 30. Juni 2023 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Barmittel in Höhe von 1.610 USD (31. Dezember 2022: 12.800 USD) wurden zum 30. Juni 2023 gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. als Sicherheit für Finanzderivate verpfändet.

Beizulegender Zeitwert[1]

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 30. Juni 2023 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie[2]	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	$ 0	$ 880.107	$ 50	$ 880.157
Investmentfonds	50.080	0	0	50.080
Pensionsgeschäfte	0	1.874	0	1.874
Finanzderivate[3]	1.739	10.071	0	11.810
Leerverkaufte Wertpapiere	0	(78.766)	0	(78.766)
Summen	**$ 51.819**	**$ 813.286**	**$ 50**	**$ 865.155**

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

Kategorie[2]	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	$ 0	$ 737.412	$ 0	$ 737.412
Investmentfonds	46.863	459	0	47.322
Pensionsgeschäfte	0	1.625	0	1.625
Finanzderivate[3]	1.705	(29.777)	0	(28.072)
Leerverkaufte Wertpapiere	0	(76.200)	0	(76.200)
Summen	**$ 48.568**	**$ 633.519**	**$ 0**	**$ 682.087**

(1) Weitere Informationen finden Sie in den Erläuterungen in Erläuterung 3.

(2) Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung des Wertpapierbestands.

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

Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC-Finanzderivate und -Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2023 und 31. Dezember 2022:

	Zum 30. Jun. 2023			Zum 31. Dez. 2022		
Kontrahent	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-engagement[1]	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-engagement[1]
AZD	$ 10	$ 20	$ 30	$ 27	$ 0	$ 27
BOA	2.647	(2.280)	367	(4.371)	3.760	(611)
BOM	k. A.	k. A.	k. A.	(9)	0	(9)
BPS	1.093	(1.080)	13	633	(530)	103
BRC	5.551	(5.420)	131	488	(400)	88
BSH	8	0	8	k. A.	k. A.	k. A.
CBK	675	(550)	125	979	(680)	299
CLY	(177)	0	(177)	(11)	0	(11)
DUB	489	(440)	49	(252)	280	28
GLM	(300)	290	(10)	(593)	420	(173)
GST	26	0	26	(35)	0	(35)
HUS	k. A.	k. A.	k. A.	(5)	0	(5)
IND	k. A.	k. A.	k. A.	193	(330)	(137)
JPM	768	(720)	48	165	0	165
MBC	2.703	(2.850)	(147)	(4.349)	3.720	(629)
MYC	(11)	10	(1)	15	10	25
MYI	394	(270)	124	(894)	490	(404)
RBC	18	0	18	(1)	0	(1)
RYL	8	(10)	(2)	(3)	0	(3)
SCX	855	(840)	15	(688)	600	(88)
SOG	(1.749)	1.290	(459)	k. A.	k. A.	k. A.
SSB	367	(290)	77	k. A.	k. A.	k. A.
TOR	(7)	0	(7)	(3.747)	3.130	(617)
UAG	658	(670)	(12)	(553)	390	(163)

(1) Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären.

Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung des Wertpapierbestands zum 30. Juni 2023:

	30. Jun. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	73,15	51,35
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	47,31	51,26
Sonstige übertragbare Wertpapiere	0,01	0,37
Investmentfonds	6,85	6,61
Pensionsgeschäfte	0,26	0,23
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	0,44	0,23
Zentral abgerechnete Finanzderivate	(0,74)	(2,33)
Freiverkehrsfinanzderivate	1,92	(1,82)
Leerverkaufte Wertpapiere	(10,78)	(10,64)

Das Anlageportfolio des Fonds konzentriert sich zum 30. Juni 2023 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	30. Jun. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
Australien	1,78	1,91
Belgien	0,11	k. A.
Brasilien	k. A.	0,21
Kanada	1,25	1,68
Cayman Inseln	3,01	2,86
China	4,20	2,16
Dänemark	2,44	2,57
Frankreich	2,82	3,25
Deutschland	2,15	2,47
Hongkong	k. A.	0,08
Ungarn	0,17	0,03
Irland	6,31	6,51
Israel	1,21	1,22
Italien	1,20	1,29
Japan	7,06	4,87
Luxemburg	0,73	0,71
Malaysia	0,62	0,92
Mexiko	0,04	0,04
Multinational	0,11	0,11
Niederlande	0,51	0,77
Neuseeland	0,09	0,09
Norwegen	0,21	0,22
Peru	0,09	1,21
Polen	0,31	0,03
Portugal	0,16	0,14
Katar	0,05	0,05
Rumänien	0,85	0,55
Saudi-Arabien	0,61	k. A.
Serbien	0,15	0,26
Singapur	0,08	k. A.
Slowenien	0,23	0,22
Südkorea	3,93	2,27
Spanien	1,11	1,50
Supranational	0,50	0,51
Schweden	0,09	0,09
Schweiz	1,23	0,95
Thailand	k. A.	0,51
Vereinigte Arabische Emirate	0,07	0,07
Großbritannien	7,31	9,28
Vereinigte Staaten	47,63	30,13
Kurzfristige Instrumente	20,05	21,24
Investmentfonds	6,85	6,61
Pensionsgeschäfte	0,26	0,23
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	0,45	0,24
Verkaufsoptionen		
Optionen auf börsengehandelte Terminkontrakte	(0,01)	(0,01)
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	0,00	(0,02)
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzkauf	(0,14)	(0,13)
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzverkauf	0,07	k. A.
Zinsswaps — Basisswaps	k. A.	0,01
Zinsswaps	(0,67)	(2,19)
Freiverkehrsfinanzderivate		
Optionskauf		
Zinsswapoptionen	0,05	0,05
Optionen auf Wertpapiere	0,09	0,09
Verkaufsoptionen		
Credit Default Swaptions auf Kreditindizes	k. A.	0,00
Zinsswapoptionen	(0,25)	(0,28)
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzkauf	k. A.	(0,01)
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	0,00	0,00
Cross-Currency Swaps	0,00	0,00
Zinsswaps	0,02	(0,02)
Total Return Swaps auf Indizes	(0,02)	0,07
Devisenterminkontrakte	2,01	(2,07)
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	0,02	0,35
Leerverkaufte Wertpapiere	(10,78)	(10,64)
Sonstige Aktiva und Passiva	(18,42)	4,74
Nettovermögen	100,00	100,00

BESCHREIBUNG		PAR (000S)		MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE					
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL					
BANKEN UND FINANZEN					
Avolon Holdings Funding Ltd.					
2,528 % fällig am 18.11.2027	$	216	$	182	0,03
Bank of America Corp.					
5,875 % fällig am 15.03.2028 (f)		602		551	0,08
DAE Sukuk Difc Ltd.					
3,750 % fällig am 15.02.2026		700		666	0,10
Ford Motor Credit Co. LLC					
3,810 % fällig am 09.01.2024		200		197	0,03
5,584 % fällig am 18.03.2024		600		596	0,09
Kaisa Group Holdings Ltd.					
9,375 % fällig am 30.06.2024 ^		650		43	0,01
9,750 % fällig am 28.09.2023 ^		1.100		74	0,01
11,700 % fällig am 11.11.2025 ^		250		17	0,00
Sunac China Holdings Ltd.					
8,350 % fällig am 19.04.2023 ^		800		118	0,02
UniCredit SpA					
7,830 % fällig am 04.12.2023		7.350		7.394	1,11
Ursa Re Ltd.					
9,208 % fällig am 07.12.2027		1.150		1.146	0,17
VICI Properties LP					
3,875 % fällig am 15.02.2029		800		703	0,10
Yango Justice International Ltd.					
7,500 % fällig am 15.04.2024 ^		1.300		27	0,00
				11.714	1,75
INDUSTRIEWERTE					
American Airlines Pass-Through Trust					
3,575 % fällig am 15.07.2029		414		385	0,06
Berry Global, Inc.					
4,875 % fällig am 15.07.2026		3.400		3.271	0,49
DAE Funding LLC					
1,625 % fällig am 15.02.2024		400		386	0,06
Energy Transfer LP					
3,750 % fällig am 15.05.2030		2.100		1.896	0,28
Las Vegas Sands Corp.					
3,200 % fällig am 08.08.2024		200		194	0,03
				6.132	0,92
VERSORGUNGSUNTERNEHMEN					
Midwest Connector Capital Co. LLC					
3,900 % fällig am 01.04.2024		3.400		3.330	0,50
Pacific Gas & Electric Co.					
2,500 % fällig am 01.02.2031		1.100		862	0,13
				4.192	0,63
Summe Unternehmensanleihen und Wechsel				22.038	3,30
WANDELANLEIHEN & WECHSEL					
Multiplan Corp. (6,000 % bar oder 7,000 % PIK)					
6,000 % fällig am 15.10.2027 (b)		1.400		950	0,14
US-REGIERUNGSBEHÖRDEN					
Fannie Mae					
1,430 % fällig am 25.03.2036 (a)		113		11	0,00
Freddie Mac					
0,000 % fällig am 15.05.2035		174		153	0,02
0,907 % fällig am 15.08.2043 (a)		327		34	0,01
Ginnie Mae					
3,858 % fällig am 20.08.2068		802		781	0,12
4,305 % fällig am 20.09.2071		6.643		6.583	0,98
Uniform Mortgage-Backed Security, TBA					
2,000 % fällig am 01.08.2053		13.000		10.620	1,59
2,500 % fällig am 01.08.2053		8.200		6.965	1,04
3,000 % fällig am 01.08.2053		4.900		4.320	0,65
3,500 % fällig am 01.08.2053		6.600		6.021	0,90
4,000 % fällig am 01.07.2053		12.100		11.357	1,70
4,500 % fällig am 01.08.2053		30.500		29.340	4,39
5,000 % fällig am 01.08.2053		31.200		30.585	4,57
5,500 % fällig am 01.08.2053		38.700		38.509	5,77
				145.279	21,74

BESCHREIBUNG		PAR (000S)		MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
US-SCHATZOBLIGATIONEN					
U.S. Treasury Bonds					
1,375 % fällig am 15.11.2040	$	5.700	$	3.818	0,57
4,000 % fällig am 15.11.2042		3.040		3.022	0,45
4,000 % fällig am 15.11.2052		2.290		2.353	0,35
U.S. Treasury Inflation Protected Securities (e)					
1,125 % fällig am 15.01.2033		40.425		38.756	5,80
				47.949	7,17
NON-AGENCY-MBS					
Bear Stearns Adjustable Rate Mortgage Trust					
4,222 % fällig am 25.07.2036 ^		96		85	0,01
4,524 % fällig am 25.02.2036 ^		36		33	0,01
Bear Stearns Mortgage Funding Trust					
5,450 % fällig am 25.04.2037		1.435		1.277	0,19
Countrywide Alternative Loan Trust					
5,450 % fällig am 25.07.2035		922		725	0,11
5,470 % fällig am 25.09.2047		192		166	0,02
6,000 % fällig am 25.04.2037		742		634	0,10
Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust					
5,770 % fällig am 25.04.2035		115		99	0,01
First Horizon Alternative Mortgage Securities Trust					
6,000 % fällig am 25.02.2037 ^		44		19	0,00
HomeBanc Mortgage Trust					
6,010 % fällig am 25.08.2029		309		294	0,04
Impac CMB Trust					
5,770 % fällig am 25.04.2035		177		163	0,02
5,795 % fällig am 25.04.2035		227		209	0,03
IndyMac Mortgage Loan Trust					
5,310 % fällig am 25.04.2037		1.812		1.574	0,24
5,710 % fällig am 25.07.2035		93		67	0,01
Lehman XS Trust					
5,550 % fällig am 25.08.2046		1.141		1.046	0,16
MASTR Adjustable Rate Mortgages Trust					
5,630 % fällig am 25.05.2037		573		250	0,04
Residential Accredit Loans, Inc. Trust					
4,165 % fällig am 25.06.2046		1.259		318	0,05
6,000 % fällig am 25.12.2036		312		250	0,04
Structured Asset Mortgage Investments Trust					
5,300 % fällig am 25.02.2037		361		325	0,05
Towd Point Mortgage Funding PLC					
5,635 % fällig am 20.10.2051	£	1.182		1.506	0,23
WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust					
5,810 % fällig am 25.01.2045	$	2.093		1.953	0,29
5,950 % fällig am 25.01.2045		579		541	0,08
6,070 % fällig am 25.10.2044		89		83	0,01
Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates Trust					
6,000 % fällig am 25.07.2036		465		325	0,05
				11.942	1,79
FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE					
Aames Mortgage Investment Trust					
5,630 % fällig am 25.04.2036		85		75	0,01
ACE Securities Corp. Home Equity Loan Trust					
5,630 % fällig am 25.06.2036		265		188	0,03
6,050 % fällig am 25.08.2035		265		255	0,04
6,275 % fällig am 25.04.2035		157		133	0,02
6,950 % fällig am 25.06.2034		1		1	0,00
Aegis Asset-Backed Securities Trust					
5,795 % fällig am 25.12.2035		452		406	0,06
Apidos CLO					
6,190 % fällig am 17.07.2030		297		294	0,04
6,260 % fällig am 20.04.2031		950		941	0,14
Ares European CLO DAC					
4,050 % fällig am 20.04.2032	€	300		321	0,05
Argent Securities Trust					
5,450 % fällig am 25.07.2036	$	1.119		955	0,14
5,470 % fällig am 25.05.2036		397		98	0,01
Asset-Backed Funding Certificates Trust					
5,290 % fällig am 25.10.2036		142		130	0,02
5,850 % fällig am 25.06.2034		563		547	0,08
5,885 % fällig am 25.03.2035		626		571	0,09
Asset-Backed Securities Corp. Home Equity Loan Trust					
3,688 % fällig am 25.12.2036		705		678	0,10

BESCHREIBUNG		PAR (000S)		MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
Atlas Senior Loan Fund Ltd.					
6,160 % fällig am 17.11.2027	$	150	$	150	0,02
Cairn CLO DAC					
3,971 % fällig am 25.04.2032	€	200		214	0,03
4,212 % fällig am 20.10.2028		16		17	0,00
Catamaran CLO Ltd.					
6,373 % fällig am 22.04.2030	$	1.147		1.140	0,17
Centex Home Equity Loan Trust					
6,200 % fällig am 25.10.2035		993		950	0,14
CIT Mortgage Loan Trust					
6,500 % fällig am 25.10.2037		263		262	0,04
Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.					
5,585 % fällig am 25.11.2036		154		150	0,02
6,050 % fällig am 25.01.2036		985		950	0,14
Countrywide Asset-Backed Certificates Trust					
3,820 % fällig am 25.12.2034		1.466		1.441	0,22
5,380 % fällig am 25.05.2037		9.305		8.634	1,29
5,410 % fällig am 25.12.2036 ^		203		182	0,03
7,100 % fällig am 25.08.2035		750		689	0,10
Ellington Loan Acquisition Trust					
6,250 % fällig am 25.05.2037		215		205	0,03
First Franklin Mortgage Loan Trust					
5,270 % fällig am 25.11.2036		582		537	0,08
5,855 % fällig am 25.11.2036		1.874		1.790	0,27
6,050 % fällig am 25.07.2035		1.456		1.425	0,21
6,095 % fällig am 25.06.2034		740		696	0,10
Fremont Home Loan Trust					
5,300 % fällig am 25.10.2036		6.542		2.671	0,40
GoldenTree Loan Management EUR CLO DAC					
4,100 % fällig am 20.01.2032	€	300		319	0,05
GSAMP Trust					
5,825 % fällig am 25.11.2035	$	416		394	0,06
Harvest CLO DAC					
4,027 % fällig am 15.01.2032	€	800		854	0,13
Home Equity Asset Trust					
3,883 % fällig am 25.02.2036	$	2.915		2.801	0,42
Invesco Euro CLO DAC					
3,827 % fällig am 15.07.2031	€	500		532	0,08
JPMorgan Mortgage Acquisition Trust					
3,982 % fällig am 25.03.2047	$	1.206		749	0,11
5,360 % fällig am 25.10.2036		47		46	0,01
5,450 % fällig am 25.03.2037		1.000		898	0,13
Jubilee CLO DAC					
4,326 % fällig am 15.12.2029	€	127		136	0,02
Lehman ABS Manufactured Housing Contract Trust					
7,170 % fällig am 15.04.2040 ^	$	794		571	0,09
Long Beach Mortgage Loan Trust					
5,750 % fällig am 25.01.2036		2.257		2.029	0,30
6,425 % fällig am 25.02.2035		510		492	0,07
Man GLG Euro CLO DAC					
4,047 % fällig am 15.01.2030	€	176		190	0,03
MASTR Asset-Backed Securities Trust					
5,360 % fällig am 25.05.2037	$	724		682	0,10
Merrill Lynch Mortgage Investors Trust					
6,080 % fällig am 25.07.2035		647		625	0,09
Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust					
5,260 % fällig am 25.03.2037		1.354		597	0,09
5,280 % fällig am 25.10.2036		83		74	0,01
5,290 % fällig am 25.10.2036		1.071		466	0,07
5,450 % fällig am 25.06.2036		253		214	0,03
6,400 % fällig am 25.07.2037		800		671	0,10
Neuberger Berman Loan Advisers CLO Ltd.					
6,290 % fällig am 20.04.2031		250		247	0,04
OCP Euro CLO DAC					
3,997 % fällig am 15.01.2032	€	1.086		1.169	0,18
4,091 % fällig am 22.09.2034		1.100		1.169	0,18
Option One Mortgage Loan Trust					
5,885 % fällig am 25.05.2035	$	500		466	0,07
6,020 % fällig am 25.05.2035		1.151		938	0,14
OZLM Ltd.					
6,400 % fällig am 20.01.2031		286		283	0,04
Palmer Square European Loan Funding DAC					
3,897 % fällig am 15.10.2031	€	2.064		2.207	0,33
3,957 % fällig am 15.04.2031		650		697	0,10
Popular ABS Mortgage Pass-Through Trust					
5,645 % fällig am 25.07.2036	$	268		251	0,04

BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
Residential Asset Mortgage Products Trust			
5,500 % fällig am 25.10.2036 $	534 $	500	0,08
Residential Asset Securities Corp. Trust			
5,400 % fällig am 25.11.2036 ^	2.983	2.582	0,39
Securitized Asset-Backed Receivables LLC Trust			
5,500 % fällig am 25.05.2037	127	93	0,01
5,930 % fällig am 25.02.2034	282	274	0,04
Segovia European CLO DAC			
4,080 % fällig am 20.07.2032 €	700	744	0,11
Sound Point CLO Ltd.			
6,412 % fällig am 18.04.2031 $	800	786	0,12
Structured Asset Investment Loan Trust			
5,770 % fällig am 25.01.2036	436	402	0,06
Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust			
5,720 % fällig am 25.10.2036	188	182	0,03
5,945 % fällig am 25.02.2036	200	189	0,03
6,155 % fällig am 25.11.2035	1.000	983	0,15
Toro European CLO DAC			
3,995 % fällig am 12.01.2032 €	300	321	0,05
Washington Mutual Asset-Backed Certificates Trust			
5,460 % fällig am 25.08.2036 $	500	468	0,07
		55.987	8,37
STAATSEMISSIONEN			
Argentina Government International Bond			
0,500 % fällig am 09.07.2030	994	273	0,04
1,500 % fällig am 09.07.2035	653	188	0,03
China Government International Bond			
3,280 % fällig am 03.12.2027 CNY	139.660	19.987	2,99
Colombian TES			
7,750 % fällig am 18.09.2030 COP	25.722.500	5.490	0,82
Japan Government International Bond			
1,700 % fällig am 20.09.2044 ¥	600.000	4.668	0,70
Peru Government International Bond			
1,862 % fällig am 01.12.2032 $	1.800	1.390	0,21
South Africa Government International Bond			
10,500 % fällig am 21.12.2026 ZAR	71.750	3.944	0,59
Spain Government International Bond			
0,700 % fällig am 30.04.2032 €	5.000	4.382	0,65
United Kingdom Gilt			
0,625 % fällig am 22.10.2050 £	3.000	1.551	0,23
		41.873	6,26

BESCHREIBUNG	AKTIEN	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
STAMMAKTIEN			
FINANZWERTE			
Bank of America Corp.	95.800 $	2.749	0,41
Citigroup, Inc.	61.100	2.813	0,42
JPMorgan Chase & Co.	21.000	3.054	0,46
Wells Fargo & Co.	71.700	3.060	0,46
		11.676	1,75
VORZUGSWERTPAPIERE			
Nationwide Building Society			
10,250 %	1.490	218	0,03
REAL ESTATE INVESTMENT TRUSTS			
Agree Realty Corp.	41.327	2.702	0,40
American Tower Corp.	9.856	1.912	0,29
Apartment Income REIT Corp.	62.213	2.245	0,34
Equinix, Inc.	2.871	2.251	0,34
Equity LifeStyle Properties, Inc.	30.425	2.035	0,30
Equity Residential	39.817	2.627	0,39
First Industrial Realty Trust, Inc.	62.470	3.288	0,49
Gaming and Leisure Properties, Inc.	48.445	2.348	0,35
Host Hotels & Resorts, Inc.	135.801	2.286	0,34
Invitation Homes, Inc.	104.896	3.608	0,54
Life Storage, Inc.	10.431	1.387	0,21
National Storage Affiliates Trust	25.381	884	0,13
Prologis, Inc.	42.264	5.183	0,78
Public Storage	4.700	1.372	0,21
RLJ Lodging Trust	138.744	1.425	0,21
SBA Communications Corp.	9.092	2.107	0,32
Simon Property Group, Inc.	22.810	2.634	0,39
Sun Communities, Inc.	13.938	1.818	0,27
Sunstone Hotel Investors, Inc.	56.900	576	0,09
VICI Properties, Inc.	77.162	2.425	0,36
		45.113	6,75

BESCHREIBUNG	AKTIEN	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
KURZFRISTIGE INSTRUMENTE			
ARGENTINA TREASURY BILLS			
(28,578) % fällig am 18.10.2023 (c)(d)	ARS 38.226 $	75	0,01
(12,549) % fällig am 23.11.2023 (c)(d)	75.134	152	0,02
		227	0,03
JAPAN TREASURY BILLS			
(0,202) % fällig am 18.07.2023 (c)(d)	¥ 8.387.000	58.031	8,68
(0,199) % fällig am 11.09.2023 (c)(d)	2.060.000	14.256	2,13
(0,184) % fällig am 04.09.2023 (c)(d)	9.458.000	65.452	9,79
(0,179) % fällig am 11.09.2023 (c)(d)	460.000	3.183	0,48
		140.922	21,08
Summe kurzfristige Instrumente		141.149	21,11
Summe Übertragbare Wertpapiere		**$ 524.174**	**78,41**
	AKTIEN		
INVESTMENTFONDS			
ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN			
PIMCO Funds: Global Investors Series plc - PIMCO Capital Securities Fund (g)	725.222	7.586	1,13
PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (g)	13.273.152	132.173	19,77
		139.759	20,90
BÖRSENGEHANDELTE FONDS			
PIMCO ETFs plc - PIMCO US Dollar Short Maturity UCITS ETF (g)	978.412	97.186	14,54
Summe Investmentfonds		**$ 236.945**	**35,44**

PENSIONSGESCHÄFTE

Kontrahent	Kredit-zins	Abrechnungs-datum	Fälligkeits-datum	Kapital-betrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensions-geschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensions-geschäft[1]	% des Nettovermögens
FICC	2,400 %	30.06.2023	03.07.2023	$ 18.513	U.S. Treasury Notes 4,625 % fällig am 30.06.2025	$ (18.883)	$ 18.513	$ 18.514	2,77
Summe Pensionsgeschäfte						**$ (18.883)**	**$ 18.513**	**$ 18.514**	**2,77**

[1] Umfasst aufgelaufene Zinsen.

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

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

FUTURES

Beschreibung	Art	Ablauf-monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Australia Government 3-Year Note September Futures	Long	09.2023	74	$ (30)	(0,01)
Australia Government 10-Year Bond September Futures	Long	09.2023	15	(6)	0,00
CAC 40 Index July Futures	Long	07.2023	29	36	0,01
Canada Government 10-Year Bond September Futures	Long	09.2023	41	(55)	(0,01)
DAX Index September Futures	Long	09.2023	3	3	0,00
E-mini S&P 500 Index September Futures	Long	09.2023	1.151	6.994	1,04
Euro STOXX 50 September Futures	Short	09.2023	91	(84)	(0,01)
Euro STOXX 600 September Futures	Long	09.2023	2.665	169	0,02
Euro-Bobl September Futures	Long	09.2023	36	(62)	(0,01)
Euro-BTP Italy Government Bond September Futures	Long	09.2023	46	47	0,01
Euro-Bund 10-Year Bond September Futures	Short	09.2023	147	209	0,03
Euro-Buxl 30-Year Bond September Futures	Long	09.2023	2	4	0,00
Euro-OAT France Government 10-Year Bond September Futures	Short	09.2023	33	25	0,00

Beschreibung	Art	Ablauf-monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
FTSE 100 Index September Futures	Short	09.2023	6	$ (3)	0,00
FTSE/MIB Index September Futures	Long	09.2023	10	48	0,01
IBEX 35 Index July Futures	Long	07.2023	1	3	0,00
Japan Government 10-Year Bond September Futures	Long	09.2023	23	95	0,01
Mini MSCI Emerging Markets Index September Futures	Long	09.2023	6	(3)	0,00
Nikkei 225 Yen-Denominated September Futures	Long	09.2023	60	290	0,04
OMXS30 Index July Futures	Long	07.2023	6	(1)	0,00
S&P/Toronto Stock Exchange 60 September Futures	Long	09.2023	67	198	0,03
SPI 200 Index September Futures	Long	09.2023	67	61	0,01
Topix Index September Futures	Long	09.2023	117	639	0,09
U.S. Treasury 2-Year Note September Futures	Long	09.2023	29	(85)	(0,01)
U.S. Treasury 5-Year Note September Futures	Long	09.2023	347	(691)	(0,10)
U.S. Treasury 10-Year Note September Futures	Short	09.2023	164	308	0,05
U.S. Treasury 10-Year Ultra September Futures	Short	09.2023	408	468	0,07
U.S. Treasury 30-Year Bond September Futures	Long	09.2023	128	35	0,01
U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond September Futures	Short	09.2023	42	(83)	(0,01)
United Kingdom Long Gilt September Futures	Long	09.2023	10	(11)	0,00
				$ 8.518	1,27

VERKAUFSOPTIONEN

OPTIONEN AUF BÖRSENGEHANDELTE TERMINKONTRAKTE

Beschreibung	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Anzahl der Kontrakte	Aufgeld	Markt-wert	% des Nettovermögens
Put - CBOT U.S. Treasury 30-Year Bond August Futures	$ 123,000	21.07.2023	29	$ (11)	$ (4)	0,00
Call - CBOT U.S. Treasury 30-Year Bond August Futures	131,000	21.07.2023	29	(15)	(6)	0,00
				$ (26)	$ (10)	0,00
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate					**$ 8.508**	**1,27**

ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)

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

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMMISSIONEN - SCHUTZVERKAUF[1]

Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag[3]	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
AT&T, Inc.	1,000 %	20.06.2026	$ 100	$ (1)	0,00
AT&T, Inc.	1,000	20.06.2028	100	1	0,00
				$ 0	0,00

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES - SCHUTZKAUF[2]

Index/Tranchen	Zu bezahlender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag[3]	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
CDX.IG-40 5-Year Index	(1,000) %	20.06.2028	$ 12.600	$ (82)	(0,01)
iTraxx Crossover 37 5-Year Index	(5,000)	20.06.2027	€ 100	0	0,00
				$ (82)	(0,01)

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES - SCHUTZVERKAUF[1]

Index/Tranchen	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag[3]	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
CDX.HY-40 5-Year Index	5,000 %	20.06.2028	$ 600	$ 20	0,00
CDX.IG-39 5-Year Index	1,000	20.12.2027	5.500	104	0,02
iTraxx Europe Main 39 5-Year Index	1,000	20.06.2028	€ 200	2	0,00
				$ 126	0,02

ZINSSWAPS

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Erhalt[4]	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	3,250 %	20.09.2053	£ 1.500	$ 134	0,02
Zahlung[4]	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	3,500	20.09.2033	4.300	(311)	(0,05)
Zahlung[4]	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	3,750	20.09.2028	1.900	(121)	(0,02)
Zahlung	1-Day INR-MIBOR Compounded-OIS	5,260	15.09.2026	INR 38.400	1	0,00
Erhalt	1-Day INR-MIBOR Compounded-OIS	6,500	21.09.2027	157.780	(11)	0,00
Zahlung	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,000	15.12.2026	¥ 1.090.000	15	0,00
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,050	15.12.2031	690.000	(55)	(0,01)
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,450	15.12.2051	300.000	(154)	(0,02)
Zahlung	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	1,000	15.03.2053	520.000	253	0,04

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits-datum		Nenn-betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Zahlung	1-Day SGD-SIBCSORA Compounded-OIS	1,250 %	15.12.2026	SGD	7.140	$ (74)	(0,01)
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	0,250	16.03.2024	$	14.500	(16)	0,00
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,750	15.06.2029		800	14	0,00
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,750	15.06.2032		14.300	438	0,07
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,750	15.06.2052		4.000	(127)	(0,02)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,750	15.06.2052		3.100	218	0,03
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,385	08.06.2032		6.100	501	0,07
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,750	21.06.2053		7.400	(15)	0,00
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,000	21.06.2033		700	23	0,00
Erhalt[4]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,085	13.02.2034		23.920	(8)	0,00
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,250	21.06.2028		12.900	326	0,05
Zahlung[4]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,308	21.02.2029		21.700	(195)	(0,03)
Zahlung[4]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,500	02.04.2026		50.600	(30)	0,00
Erhalt[4]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,500	20.12.2030		15.300	(16)	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,525	02.03.2030		1.600	(22)	0,00
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,750	21.06.2025		48.700	673	0,10
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,800	10.03.2028		4.504	(37)	(0,01)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,575	04.01.2027	BRL	39.700	380	0,06
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	2,250	21.09.2052	CAD	2.600	(195)	(0,03)
Zahlung	3-Month CNY-CNREPOFIX	2,250	21.12.2027	CNY	16.100	19	0,00
Zahlung	3-Month CNY-CNREPOFIX	2,500	15.12.2026		77.410	120	0,02
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	4,920	26.08.2026	COP	21.200.000	483	0,07
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	5,925	26.08.2026		20.900.000	(336)	(0,05)
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	7,215	09.02.2027		7.022.570	(91)	(0,01)
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	7,620	18.09.2030		29.000.000	(75)	(0,01)
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	8,585	26.11.2025		21.088.900	34	0,01
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	8,590	26.11.2025		22.207.400	35	0,01
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	8,930	18.09.2030		2.700.000	(52)	(0,01)
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	9,280	26.11.2025		24.084.000	(50)	(0,01)
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	10,270	17.11.2027		16.699.000	356	0,05
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	10,580	10.01.2028		14.369.470	(231)	(0,03)
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	10,840	02.12.2025		74.238.900	784	0,12
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	10,960	21.11.2025		11.115.900	(120)	(0,02)
Erhalt	3-Month ILS-TELBOR	1,215	11.02.2027	ILS	24.750	(32)	(0,01)
Zahlung	3-Month KRW-KORIBOR	1,268	17.03.2031	KRW	2.741.200	(41)	(0,01)
Zahlung	3-Month KRW-KORIBOR	1,336	17.03.2031		1.600.000	(24)	0,00
Zahlung	3-Month KRW-KORIBOR	2,500	16.03.2027		6.799.000	(65)	(0,01)
Erhalt	3-Month THB-THORON Compounded-OIS	2,250	15.03.2028	THB	37.400	0	0,00
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	5,980	21.12.2026	ZAR	151.000	155	0,02
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	6,690	04.11.2026		133.520	(62)	(0,01)
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	5,850	14.01.2027	CLP	4.026.240	(58)	(0,01)
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	6,045	11.02.2027		454.450	2	0,00
Erhalt	6-Month CZK-PRIBOR	5,225	29.07.2027	CZK	86.860	(92)	(0,01)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	0,081	15.02.2031	€	24.400	(3.141)	(0,48)
Zahlung[4]	6-Month EUR-EURIBOR	2,500	20.09.2053		4.700	107	0,02
Zahlung[4]	6-Month EUR-EURIBOR	3,000	20.09.2028		7.100	17	0,00
Zahlung[4]	6-Month EUR-EURIBOR	3,000	20.09.2033		14.200	122	0,02
Zahlung[4]	6-Month EUR-EURIBOR	3,500	20.09.2025		17.400	8	0,00
Erhalt	6-Month HUF-BBR	3,700	08.11.2026	HUF	1.841.500	(233)	(0,04)
Zahlung	6-Month HUF-BBR	11,070	02.09.2027		450.700	179	0,03
Zahlung	6-Month PLN-WIBOR	2,983	08.11.2026	PLN	9.840	37	0,01
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	7,745	11.02.2027	MXN	37.430	21	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	8,480	24.01.2028		188.200	59	0,01
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	8,700	05.11.2027		63.500	30	0,00
						$ (546)	(0,09)
Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate						**$ (502)**	**(0,08)**

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

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

(3) Der maximal mögliche Betrag, den der Fonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

(4) Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft.

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

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

VERKAUFSOPTIONEN

INFLATION-CAPPED OPTIONS

Kontrahent	Beschreibung	Anfänglicher Index	Variabler Zinssatz	Verfalls-datum	Nenn-betrag[1]	Aufgeld	Markt-wert	% des Nettovermögens
GLM	Cap - OTC CPALEMU	$ 100,151	Maximal [(Index Final/Index Initial - 1) - 3,000 %] oder 0	22.06.2035	8.200	$ (374)	$ (461)	(0,07)
JPM	Cap - OTC CPURNSA	234,781	Maximal [(Index Final/Index Initial - 1) - 4,000 %] oder 0	16.05.2024	1.500	(10)	0	0,00
						$ (384)	$ (461)	(0,07)

ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag[1]	Aufgeld	Markt-wert	% des Nettovermögens
BOA	Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,060 %	14.07.2023	1.942	$ (14)	$ (9)	0,00
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,360	14.07.2023	1.942	(14)	(4)	0,00
BPS	Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,000	03.07.2023	1.963	(13)	0	0,00
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,400	03.07.2023	1.963	(13)	0	0,00
BRC	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,260	26.07.2023	1.681	(6)	(3)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,660	26.07.2023	1.681	(5)	(8)	0,00
	Call - OTC 7-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,350	27.07.2023	2.546	(6)	(5)	0,00
	Put - OTC 7-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,850	27.07.2023	2.546	(6)	(9)	0,00
FAR	Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,000	03.07.2023	2.524	(17)	0	0,00
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,400	03.07.2023	2.524	(17)	0	0,00
GLM	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,260	26.07.2023	4.759	(16)	(10)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,660	26.07.2023	4.759	(16)	(23)	(0,01)
	Call - OTC 7-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,350	27.07.2023	2.546	(6)	(5)	0,00
	Put - OTC 7-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,850	27.07.2023	2.546	(6)	(9)	0,00
JPM	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,250	20.07.2023	5.493	(19)	(7)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,650	20.07.2023	5.493	(19)	(23)	(0,01)
MYC	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,270	24.07.2023	3.880	(13)	(7)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,670	24.07.2023	3.880	(13)	(16)	0,00
							$ (219)	$ (138)	(0,02)

[1] Der Nennbetrag stellt die Anzahl der Kontrakte dar.

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES - SCHUTZVERKAUF[1]

Kontrahent	Index/Tranchen	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag[2]	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Markt-wert	% des Nettovermö-gens
GST	CMBX.NA.AAA.10 Index	0,500 %	17.11.2059	$ 2.900	$ (86)	$ 74	$ (12)	0,00
MYC	CMBX.NA.AAA.10 Index	0,500	17.11.2059	12.200	(403)	353	(50)	(0,02)
SAL	CMBX.NA.AAA.12 Index	0,500	17.08.2061	2.200	(5)	(19)	(24)	0,00
UAG	CMBX.NA.AAA.10 Index	0,500	17.11.2059	5.100	(148)	127	(21)	0,00
					$ (642)	$ 535	$ (107)	(0,02)

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

[2] Der maximal mögliche Betrag, den der Fonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

ZINSSWAPS

Kontrahent	Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Markt-wert	% des Nettovermö-gens
BOA	Zahlung	3-Month MYR-KLIBOR	2,750 %	15.12.2026	MYR 2.450	$ (6)	$ (9)	$ (15)	0,00
	Zahlung	3-Month MYR-KLIBOR	3,000	16.03.2027	40.990	(184)	(15)	(199)	(0,03)
CBK	Zahlung	3-Month KRW-KORIBOR	1,430	01.07.2029	KRW 100	0	0	0	0,00
						$ (190)	$ (24)	$ (214)	(0,03)

TOTAL RETURN SWAPS AUF INDIZES

Kontrahent	Zahlung/Erhalt	Wertpapier	Anzahl der Anteile oder Einheiten	Variabler Zinssatz	Nenn-betrag	Fälligkeits-datum	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Markt-wert	% des Nettovermö-gens
BOA	Zahlung	DWRTFT Index	1.880	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	$ 20.857	23.08.2023	$ 0	$ (970)	$ (970)	(0,14)
BPS	Erhalt	iBoxx USD Liquid Investment Grade Index	k. A.	1,084 %	100	20.12.2023	(1)	2	1	0,00
	Zahlung	IXITR Index	2.419	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	9.187	21.02.2024	0	(209)	(209)	(0,03)

Kontrahent	Zahlung/Erhalt	Wertpapier	Anzahl der Anteile oder Einheiten	Variabler Zinssatz	Nenn-betrag	Fälligkeits-datum	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Markt-wert	% des Nettovermögens
JPM	Zahlung	NDUEACWF Index	40.416	1-Month USD-LIBOR less a specified spread	$ 13.822	06.09.2023	$ 0	$ (747)	$ (747)	(0,11)
	Zahlung	DWRTFT Index	453	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	5.018	21.02.2024	0	(242)	(242)	(0,04)
MBC	Receive	NDUEEGF Index	24.335	1-Month USD-LIBOR plus a specified spread	11.953	06.12.2023	0	403	403	0,06
	Receive	NDUEEGF Index	24.335	1-Month USD-LIBOR plus a specified spread	11.953	17.01.2024	0	404	404	0,06
	Receive	NDUEEGF Index	24.335	1-Month USD-LIBOR plus a specified spread	11.953	06.03.2024	0	405	405	0,06
MYI	Receive	NDUEEGF Index	24.335	1-Month USD-LIBOR plus a specified spread	12.419	08.05.2024	0	(53)	(53)	(0,01)
SOG	Zahlung	DWRTFT Index	1.252	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	13.886	03.04.2024	0	(650)	(650)	(0,10)
							$ (1)	$ (1.657)	$ (1.658)	(0,25)

DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung		Zu erhaltende Währung		Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
AZD	07.2023	AUD	1.401	$	930	$ 0	$ (3)	$ (3)	0,00
	07.2023	$	226	AUD	345	4	0	4	0,00
	08.2023		931		1.401	3	0	3	0,00
BOA	07.2023	DKK	342	$	50	0	0	0	0,00
	07.2023	NZD	1.616		980	0	(10)	(10)	0,00
	07.2023	SEK	2.505		231	0	0	0	0,00
	07.2023	$	1.433	AUD	2.195	28	0	28	0,00
	07.2023		10.903	CAD	14.836	308	0	308	0,05
	07.2023		86	DKK	597	1	0	1	0,00
	07.2023		5.431	ILS	18.604	0	(419)	(419)	(0,06)
	07.2023		4.914	MXN	90.475	348	0	348	0,05
	07.2023		1.124	NOK	12.358	29	0	29	0,00
	07.2023		98	SEK	1.060	0	0	0	0,00
	08.2023	CNY	333	$	49	2	0	2	0,00
	08.2023	SEK	1.059		98	0	0	0	0,00
	08.2023	$	245	CNY	1.753	0	(2)	(2)	0,00
	08.2023		50	DKK	341	0	0	0	0,00
	08.2023		3.014	ILS	10.304	0	(235)	(235)	(0,03)
	09.2023	IDR	291.840	$	19	0	0	0	0,00
	09.2023	TWD	50.832		1.674	39	0	39	0,01
	09.2023	$	194	CLP	157.827	1	0	1	0,00
	09.2023		1.009	HKD	7.888	0	(1)	(1)	0,00
	09.2023		297	KRW	381.649	0	(6)	(6)	0,00
BPS	07.2023	AUD	1.002	$	663	0	(3)	(3)	0,00
	07.2023	CHF	667		746	0	0	0	0,00
	07.2023	CZK	241		11	0	0	0	0,00
	07.2023	DKK	1.610		232	0	(4)	(4)	0,00
	07.2023	€	48.875		53.552	230	0	230	0,03
	07.2023	ILS	11.722		3.679	520	0	520	0,08
	07.2023	NOK	2.883		268	0	(1)	(1)	0,00
	07.2023	$	24.932	¥	3.465.815	0	(954)	(954)	(0,14)
	08.2023	CNH	80.072	$	11.588	545	0	545	0,08
	08.2023	CNY	392		57	3	0	3	0,00
	08.2023	TWD	25.443		833	16	0	16	0,00
	08.2023	$	664	AUD	1.002	3	0	3	0,00
	08.2023		746	CHF	665	0	0	0	0,00
	08.2023		53.627	€	48.875	0	(232)	(232)	(0,03)
	08.2023		268	NOK	2.880	1	0	1	0,00
	08.2023	ZAR	39.221	$	2.108	40	0	40	0,01
	09.2023	THB	14		0	0	0	0	0,00
BRC	07.2023	£	148		188	0	0	0	0,00
	07.2023	¥	8.387.000		64.844	6.704	0	6.704	1,01
	07.2023	$	13	MYR	60	0	0	0	0,00
	08.2023	CNY	6.672	$	953	30	0	30	0,00
	08.2023	COP	48.730.586		11.438	0	(88)	(88)	(0,01)
	08.2023	ZAR	47.456		2.568	66	0	66	0,01
	09.2023	¥	9.458.000		68.464	2.400	0	2.400	0,36
	09.2023	$	170	ILS	608	0	(6)	(6)	0,00
	10.2023	MXN	55.614	$	2.968	0	(212)	(212)	(0,03)
CBK	07.2023	€	2.748		3.006	8	0	8	0,00
	07.2023	ILS	6.893		2.151	294	0	294	0,04
	07.2023	$	3.595	CLP	2.909.470	28	0	28	0,00
	07.2023		44	NOK	485	2	0	2	0,00
	08.2023	CLP	3.210.667	$	3.912	0	(65)	(65)	(0,01)
	08.2023	CNH	220		32	1	0	1	0,00
	08.2023	ILS	10.315		3.192	410	0	410	0,06
	08.2023	TWD	34.655		1.136	23	0	23	0,00
	08.2023	$	4.364	CNY	30.650	0	(124)	(124)	(0,02)
	09.2023	KRW	1.181	$	1	0	0	0	0,00
	09.2023	MXN	8.169		441	0	(27)	(27)	0,00

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung		Zu erhaltende Währung		Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
CLY	07.2023	$	253	DKK	1.755	$ 4	$ 0	$ 4	0,00
DUB	07.2023		5.418	BRL	29.357	667	0	667	0,10
	08.2023		106	ZAR	2.038	2	0	2	0,00
FAR	07.2023		5	CLP	3.986	0	0	0	0,00
GLM	07.2023	BRL	29.447	$	6.094	0	(10)	(10)	0,00
	07.2023	NOK	17.783		1.650	0	(10)	(10)	0,00
	08.2023	$	319	CNY	2.198	0	(15)	(15)	0,00
	08.2023		1.650	NOK	17.765	10	0	10	0,00
	09.2023	SGD	2.357	$	1.764	17	0	17	0,00
	09.2023	$	5.898	BRL	28.794	5	0	5	0,00
	09.2023		348	COP	1.472.799	0	(3)	(3)	0,00
	09.2023		920	TWD	27.985	0	(19)	(19)	0,00
JPM	07.2023	¥	1.180.269	$	8.253	87	0	87	0,01
	07.2023	$	1.378	AUD	2.108	25	0	25	0,00
	07.2023		1.130	SGD	1.493	0	(26)	(26)	0,00
	08.2023	CNH	64.275	$	9.301	437	0	437	0,07
	08.2023	CNY	414		60	3	0	3	0,00
	08.2023	$	1.363	HUF	475.800	12	0	12	0,00
	08.2023		8.253	¥	1.175.254	0	(87)	(87)	(0,01)
	08.2023		247	TWD	7.550	0	(5)	(5)	0,00
	08.2023	ZAR	3.516	$	181	0	(4)	(4)	0,00
	09.2023	IDR	122.083		8	0	0	0	0,00
	09.2023	INR	44.392		539	0	(1)	(1)	0,00
	09.2023	PEN	1.675		455	0	(4)	(4)	0,00
	09.2023	$	5	IDR	78.757	0	0	0	0,00
	09.2023		164	ILS	583	0	(7)	(7)	0,00
	09.2023		2.336	THB	80.101	0	(60)	(60)	(0,01)
	10.2023	MXN	26.988	$	1.537	0	(6)	(6)	0,00
MBC	07.2023	CHF	592		657	0	(5)	(5)	0,00
	07.2023	£	3.233		4.002	0	(108)	(108)	(0,02)
	09.2023	¥	2.520.000		18.357	738	0	738	0,11
	09.2023	$	227	INR	18.794	1	0	1	0,00
	09.2023		175	KRW	223.406	0	(5)	(5)	0,00
MYI	07.2023	AUD	521	$	349	2	0	2	0,00
	07.2023	£	96		119	0	(3)	(3)	0,00
	07.2023	IDR	76.925		5	0	0	0	0,00
	07.2023	NZD	107		65	0	(1)	(1)	0,00
	07.2023	$	3.999	COP	16.859.264	13	0	13	0,00
	07.2023		118	€	108	0	0	0	0,00
	07.2023		39	£	31	0	0	0	0,00
	07.2023		5	IDR	76.925	0	0	0	0,00
	07.2023		135	SEK	1.446	0	(1)	(1)	0,00
	08.2023	TWD	27.379	$	903	24	0	24	0,00
	08.2023	$	2	TWD	72	0	0	0	0,00
	08.2023		560	ZAR	10.502	4	(11)	(7)	0,00
	09.2023	IDR	76.992	$	5	0	0	0	0,00
	09.2023	ILS	193		54	2	0	2	0,00
	09.2023	INR	9.588		116	0	0	0	0,00
	09.2023	$	196	KRW	251.072	0	(5)	(5)	0,00
	09.2023		1.066	THB	36.512	0	(29)	(29)	0,00
RBC	07.2023	CAD	857	$	649	1	0	1	0,00
	07.2023	$	3.063	MXN	58.943	367	0	367	0,06
	08.2023	MXN	63.121	$	3.642	0	(8)	(8)	0,00
	09.2023	ZAR	30.034		1.668	91	0	91	0,01
RYL	07.2023	$	2.206	NZD	3.553	0	(29)	(29)	0,00
SCX	07.2023	AUD	2.058	$	1.366	0	(4)	(4)	0,00
	07.2023	NZD	4.208		2.555	0	(23)	(23)	0,00
	07.2023	$	2.055	AUD	3.145	38	0	38	0,01
	07.2023		1.350	CHF	1.213	6	0	6	0,00
	08.2023	CNH	30.465	$	4.428	226	0	226	0,03
	08.2023	CNY	1.098		161	9	0	9	0,00
	08.2023	$	1.367	AUD	2.058	4	0	4	0,00
	09.2023	INR	27.764	$	337	0	0	0	0,00
	09.2023	TWD	42.475		1.393	27	0	27	0,00
	09.2023	$	5.245	IDR	77.991.713	0	(65)	(65)	(0,01)
	09.2023		2.400	THB	82.892	0	(45)	(45)	(0,01)
	09.2023		1.149	ZAR	19.983	0	(99)	(99)	(0,01)
SOG	07.2023		1.490	AUD	2.277	26	0	26	0,00
	07.2023		55.533	€	51.623	788	0	788	0,12
SSB	07.2023	CLP	2.605.728	$	3.244	0	(1)	(1)	0,00
	08.2023	$	3.244	CLP	2.613.253	0	0	0	0,00
	09.2023	BRL	6.702	$	1.322	0	(52)	(52)	(0,01)
TOR	07.2023	AUD	2.533		1.673	0	(13)	(13)	0,00
	07.2023	CAD	9.906		7.464	0	(22)	(22)	0,00
	07.2023	$	788	AUD	1.205	14	0	14	0,00
	07.2023		4.418	£	3.477	2	0	2	0,00
	07.2023		1.448	NZD	2.378	9	0	9	0,00
	08.2023	£	3.477	$	4.419	0	(2)	(2)	0,00
	08.2023	NZD	2.378		1.448	0	(9)	(9)	0,00
	08.2023	$	1.674	AUD	2.533	13	0	13	0,00
	08.2023		7.464	CAD	9.902	22	0	22	0,00
	08.2023		861	HUF	301.368	10	0	10	0,00
UAG	07.2023	AUD	4.036	$	2.695	14	(6)	8	0,00

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung		Zu erhaltende Währung		Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
	07.2023	$	181	AUD	276	$ 3	$ 0	$ 3	0,00
	07.2023		88	CHF	79	0	0	0	0,00
	07.2023		781	NOK	8.645	26	0	26	0,00
	08.2023		2.697	AUD	4.036	6	(14)	(8)	0,00
	09.2023		90	ILS	322	0	(3)	(3)	0,00
	09.2023		569	ZAR	10.051	0	(41)	(41)	(0,01)
						$ 15.842	$ (3.253)	$ 12.589	1,89

ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklassen Institutional EUR (Hedged) thesaurierend, E Class EUR (Hedged) thesaurierend und E Class EUR (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung		Zu erhaltende Währung		Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
AZD	07.2023	AUD	266	$	174	$ 0	$ (3)	$ (3)	0,00
	07.2023	$	672	AUD	1.013	2	0	2	0,00
	08.2023	AUD	1.013	$	673	0	(2)	(2)	0,00
BOA	07.2023		1.694		1.106	0	(22)	(22)	0,00
	07.2023	CAD	12.264		9.013	0	(256)	(256)	(0,04)
	07.2023	CLP	144.422		178	0	(2)	(2)	0,00
	07.2023	DKK	3.711		536	0	(8)	(8)	0,00
	07.2023	€	2.002		2.186	3	(1)	2	0,00
	07.2023	HUF	60.219		173	0	(4)	(4)	0,00
	07.2023	¥	75.749		545	21	0	21	0,00
	07.2023	KRW	17.816		13	0	0	0	0,00
	07.2023	NOK	2.493		227	0	(6)	(6)	0,00
	07.2023	NZD	109		66	0	(1)	(1)	0,00
	07.2023	SEK	186		17	0	0	0	0,00
	07.2023	$	5	BRL	25	0	0	0	0,00
	07.2023		179	CLP	144.422	1	0	1	0,00
	07.2023		991	DKK	6.736	0	(4)	(4)	0,00
	07.2023		137.943	€	128.354	2.093	0	2.093	0,31
	07.2023		854	THB	30.392	3	0	3	0,00
	08.2023	CLP	144.422	$	178	0	(1)	(1)	0,00
	08.2023	DKK	6.725		991	4	0	4	0,00
	08.2023	THB	30.392		856	0	(3)	(3)	0,00
BPS	07.2023	BRL	0		0	0	0	0	0,00
	07.2023	CHF	83		92	0	(1)	(1)	0,00
	07.2023	CZK	3.195		145	0	(2)	(2)	0,00
	07.2023	DKK	13		2	0	0	0	0,00
	07.2023	€	143.429		157.156	675	0	675	0,10
	07.2023	¥	2.121.726		15.271	593	0	593	0,09
	07.2023	NZD	10		6	0	0	0	0,00
	07.2023	TWD	158.157		5.164	87	0	87	0,01
	07.2023	$	1.008	AUD	1.533	13	0	13	0,00
	07.2023		7.374	CHF	6.595	0	(2)	(2)	0,00
	07.2023		1.741	CNY	12.580	0	(8)	(8)	0,00
	07.2023		154.756	€	143.957	2.302	0	2.302	0,35
	07.2023		57	NOK	608	0	0	0	0,00
	08.2023	AUD	724	$	480	0	(2)	(2)	0,00
	08.2023	CHF	6.576		7.374	2	0	2	0,00
	08.2023	CNY	12.562		1.741	5	0	5	0,00
	08.2023	NOK	608		57	0	0	0	0,00
	08.2023	$	156.997	€	143.083	0	(680)	(680)	(0,10)
BRC	07.2023	PLN	1.320	$	313	0	(12)	(12)	0,00
	07.2023	$	4.082	KRW	5.388.015	7	0	7	0,00
	08.2023	KRW	5.381.238	$	4.082	0	(7)	(7)	0,00
CBK	07.2023	€	122.100		132.751	18	(479)	(461)	(0,07)
	07.2023	INR	138		2	0	0	0	0,00
	07.2023	MXN	15.257		848	0	(42)	(42)	(0,01)
	07.2023	NOK	222		20	0	(1)	(1)	0,00
	07.2023	$	1.827	BRL	8.735	0	(16)	(16)	0,00
	07.2023		219	ILS	796	0	(5)	(5)	0,00
	07.2023		888	MXN	15.257	2	0	2	0,00
	07.2023		5.091	TWD	158.638	2	0	2	0,00
	08.2023	BRL	8.735	$	1.817	15	0	15	0,00
	08.2023	ILS	795		219	5	0	5	0,00
	08.2023	MXN	15.257		883	0	(2)	(2)	0,00
	08.2023	TWD	158.640		5.091	0	0	0	0,00
	08.2023	$	123.117	€	113.082	425	0	425	0,06
CLY	07.2023	DKK	10.906	$	1.574	0	(24)	(24)	0,00
	07.2023	$	185	CHF	167	1	0	1	0,00
	08.2023	CHF	166	$	185	0	(1)	(1)	0,00
GLM	07.2023	BRL	8.760		1.749	0	(67)	(67)	(0,01)
	07.2023	MYR	3.191		711	28	0	28	0,00
	07.2023	THB	30.392		880	23	0	23	0,00
	07.2023	$	348	NOK	3.753	2	0	2	0,00
	08.2023	NOK	3.749	$	348	0	(2)	(2)	0,00
JPM	07.2023	AUD	1.627		1.064	0	(19)	(19)	0,00

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung		Zu erhaltende Währung		Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
	07.2023	€	143.271	$	156.438	$ 129	$ 0	$ 129	0,02
	07.2023	INR	360.848		4.357	0	(41)	(41)	(0,01)
	07.2023	$	4.399	INR	361.160	3	0	3	0,00
	07.2023		5.233	¥	748.341	0	(55)	(55)	(0,01)
	07.2023		41	SGD	55	0	0	0	0,00
	07.2023	ZAR	13.394	$	675	0	(34)	(34)	(0,01)
	08.2023	INR	361.490		4.399	0	(2)	(2)	0,00
	08.2023	¥	745.161		5.233	55	0	55	0,01
	08.2023	SGD	55		41	0	0	0	0,00
	08.2023	$	156.656	€	143.271	0	(135)	(135)	(0,02)
MBC	07.2023	CNY	88	$	12	0	0	0	0,00
	07.2023	€	5.409		5.873	14	(43)	(29)	0,00
	07.2023	£	9.360		11.586	0	(314)	(314)	(0,05)
	07.2023	SEK	346		32	0	0	0	0,00
	07.2023	SGD	1.062		786	1	0	1	0,00
	07.2023	$	795	CAD	1.078	19	0	19	0,00
	07.2023		63	€	58	1	0	1	0,00
	07.2023		1.229	£	986	25	0	25	0,00
MYI	07.2023	CHF	0	$	0	0	0	0	0,00
	07.2023	ILS	794		213	0	(1)	(1)	0,00
	07.2023	PHP	30.827		552	0	(7)	(7)	0,00
	07.2023	SEK	26.711		2.488	15	0	15	0,00
	07.2023	$	147	CZK	3.195	0	(1)	(1)	0,00
	07.2023		881	DKK	6.007	0	0	0	0,00
	07.2023		952	IDR	14.342.248	4	0	4	0,00
	07.2023		688	MYR	3.191	0	(4)	(4)	0,00
	07.2023		326	PLN	1.321	0	(1)	(1)	0,00
	07.2023		2.527	SEK	27.285	0	(1)	(1)	0,00
	07.2023		814	SGD	1.100	0	(1)	(1)	0,00
	07.2023	ZAR	14.424	$	732	0	(32)	(32)	0,00
	08.2023	CZK	3.199		147	1	0	1	0,00
	08.2023	DKK	5.997		881	0	0	0	0,00
	08.2023	IDR	14.347.672		952	0	(2)	(2)	0,00
	08.2023	MYR	3.191		689	4	0	4	0,00
	08.2023	PLN	1.323		326	1	0	1	0,00
	08.2023	SEK	27.251		2.527	1	0	1	0,00
	08.2023	SGD	1.099		814	1	0	1	0,00
SCX	07.2023	AUD	2.296		1.501	0	(28)	(28)	0,00
	07.2023	CHF	6.426		7.151	0	(31)	(31)	0,00
	07.2023	NZD	284		172	0	(2)	(2)	0,00
	07.2023	$	988	AUD	1.488	3	0	3	0,00
	07.2023		1	IDR	20.238	0	0	0	0,00
	08.2023	AUD	1.488	$	988	0	(3)	(3)	0,00
SOG	07.2023		1.757		1.150	0	(20)	(20)	0,00
	07.2023	HKD	65.217		8.332	10	0	10	0,00
	07.2023	$	154.765	€	143.868	2.197	0	2.197	0,33
	07.2023		1.491	ZAR	27.856	0	(16)	(16)	0,00
	08.2023	ZAR	27.934	$	1.491	16	0	16	0,00
TOR	07.2023	AUD	930		608	0	(11)	(11)	0,00
	07.2023	$	1.209	AUD	1.831	9	0	9	0,00
	07.2023		8.455	CAD	11.187	6	(6)	0	0,00
	07.2023		10.640	£	8.374	5	0	5	0,00
	07.2023		179	HUF	60.339	0	(2)	(2)	0,00
	07.2023		10.063	¥	1.449.033	0	(37)	(37)	(0,01)
	07.2023		245	NZD	402	1	0	1	0,00
	08.2023	AUD	1.831	$	1.210	0	(9)	(9)	0,00
	08.2023	CAD	11.183		8.455	6	(6)	0	0,00
	08.2023	£	8.374		10.643	0	(5)	(5)	0,00
	08.2023	HUF	60.795		179	2	0	2	0,00
	08.2023	¥	1.442.888		10.063	38	0	38	0,01
	08.2023	NZD	402		245	0	(1)	(1)	0,00
UAG	07.2023	AUD	213		139	0	(2)	(2)	0,00
	07.2023	CHF	418		466	0	(2)	(2)	0,00
	07.2023	CNY	12.526		1.782	56	0	56	0,01
	07.2023	IDR	14.287.784		952	0	0	0	0,00
	07.2023	KRW	5.360.687		4.065	0	(4)	(4)	0,00
	07.2023	NOK	1.820		164	0	(5)	(5)	0,00
	07.2023	SGD	94		69	0	0	0	0,00
	07.2023	$	1.948	AUD	2.918	4	(10)	(6)	0,00
	07.2023		181	CHF	162	0	0	0	0,00
	07.2023		557	PHP	30.861	2	0	2	0,00
	08.2023	AUD	2.918	$	1.950	10	(4)	6	0,00
	08.2023	CHF	162		181	0	0	0	0,00
	08.2023	PHP	30.878		557	0	(1)	(1)	0,00
						$ 8.971	$ (2.564)	$ 6.407	0,96

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklasse Institutional GBP (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung		Zu erhaltende Währung		Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
AZD	07.2023	AUD	4	$	3	$ 0	$ 0	$ 0	0,00
	07.2023	$	6	AUD	9	0	0	0	0,00
	08.2023	AUD	9	$	6	0	0	0	0,00
BOA	07.2023		5		3	0	0	0	0,00
	07.2023	CAD	100		74	0	(2)	(2)	0,00
	07.2023	CLP	2.256		3	0	0	0	0,00
	07.2023	CNY	1		0	0	0	0	0,00
	07.2023	DKK	34		5	0	0	0	0,00
	07.2023	HUF	728		2	0	0	0	0,00
	07.2023	¥	1.574		11	0	0	0	0,00
	07.2023	KRW	126		0	0	0	0	0,00
	07.2023	NOK	30		3	0	0	0	0,00
	07.2023	NZD	1		1	0	0	0	0,00
	07.2023	SEK	4		0	0	0	0	0,00
	07.2023	$	0	BRL	0	0	0	0	0,00
	07.2023		3	CLP	2.256	0	0	0	0,00
	07.2023		9	DKK	62	0	0	0	0,00
	07.2023		20	SEK	212	0	0	0	0,00
	07.2023		8	THB	302	0	0	0	0,00
	08.2023	CLP	2.256	$	3	0	0	0	0,00
	08.2023	DKK	62		9	0	0	0	0,00
	08.2023	SEK	212		20	0	0	0	0,00
	08.2023	THB	302		9	0	0	0	0,00
BPS	07.2023	BRL	0		0	0	0	0	0,00
	07.2023	CHF	1		1	0	0	0	0,00
	07.2023	CZK	38		2	0	0	0	0,00
	07.2023	DKK	0		0	0	0	0	0,00
	07.2023	¥	17.100		123	5	0	5	0,00
	07.2023	NZD	0		0	0	0	0	0,00
	07.2023	TWD	1.187		39	1	0	1	0,00
	07.2023	$	4	AUD	6	0	0	0	0,00
	07.2023		60	CHF	54	0	0	0	0,00
	07.2023		14	CNY	101	0	0	0	0,00
	07.2023		205	€	187	0	(1)	(1)	0,00
	07.2023		1.217	£	984	34	0	34	0,01
	07.2023		1	NOK	7	0	0	0	0,00
	08.2023	AUD	6	$	4	0	0	0	0,00
	08.2023	CHF	54		60	0	0	0	0,00
	08.2023	CNY	101		14	0	0	0	0,00
	08.2023	€	184		202	1	0	1	0,00
	08.2023	NOK	7		1	0	0	0	0,00
BRC	07.2023	£	48		62	0	0	0	0,00
	07.2023	PLN	16		4	0	0	0	0,00
	07.2023	$	29	KRW	38.167	0	0	0	0,00
	08.2023	KRW	38.119	$	29	0	0	0	0,00
CBK	07.2023	INR	1		0	0	0	0	0,00
	07.2023	MXN	171		10	0	0	0	0,00
	07.2023	NOK	3		0	0	0	0	0,00
	07.2023	$	14	BRL	69	0	0	0	0,00
	07.2023		5	€	4	0	0	0	0,00
	07.2023		3	ILS	12	0	0	0	0,00
	07.2023		10	MXN	171	0	0	0	0,00
	07.2023		38	TWD	1.191	0	0	0	0,00
	08.2023	BRL	69	$	14	0	0	0	0,00
	08.2023	ILS	12		3	0	0	0	0,00
	08.2023	MXN	171		10	0	0	0	0,00
	08.2023	TWD	1.191		38	0	0	0	0,00
CLY	07.2023	DKK	100		14	0	0	0	0,00
	07.2023	$	2	CHF	1	0	0	0	0,00
	08.2023	CHF	1	$	2	0	0	0	0,00
GLM	07.2023	BRL	69		14	0	(1)	(1)	0,00
	07.2023	MYR	22		5	0	0	0	0,00
	07.2023	THB	302		9	0	0	0	0,00
	07.2023	$	4	NOK	45	0	0	0	0,00
	08.2023	NOK	45	$	4	0	0	0	0,00
JPM	07.2023	£	1.064		1.345	0	(7)	(7)	(0,01)
	07.2023	INR	2.769		33	0	0	0	0,00
	07.2023	$	34	INR	2.772	0	0	0	0,00
	07.2023		44	¥	6.359	0	(1)	(1)	0,00
	07.2023		0	SGD	1	0	0	0	0,00
	08.2023	INR	2.774	$	34	0	0	0	0,00
	08.2023	¥	6.332		44	0	0	0	0,00
	08.2023	SGD	1		0	0	0	0	0,00
	08.2023	$	1.345	£	1.064	7	0	7	0,00
MBC	07.2023	CAD	0	$	0	0	0	0	0,00
	07.2023	£	17		21	0	0	0	0,00
	07.2023	SGD	10		8	0	0	0	0,00
	07.2023	$	1.355	£	1.094	36	0	36	0,01
MYI	07.2023	ILS	12	$	3	0	0	0	0,00
	07.2023	PHP	147		3	0	0	0	0,00
	07.2023	SEK	208		19	0	0	0	0,00

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung		Zu erhaltende Währung		Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
	07.2023	$	2	CZK	39	$ 0	$ 0	$ 0	0,00
	07.2023		8	DKK	55	0	0	0	0,00
	07.2023		1.318	£	1.060	30	0	30	0,00
	07.2023		6	IDR	87.612	0	0	0	0,00
	07.2023		5	MYR	22	0	0	0	0,00
	07.2023		4	PLN	16	0	0	0	0,00
	07.2023		8	SGD	11	0	0	0	0,00
	07.2023	ZAR	191	$	10	0	0	0	0,00
	08.2023	CZK	39		2	0	0	0	0,00
	08.2023	DKK	55		8	0	0	0	0,00
	08.2023	IDR	87.645		6	0	0	0	0,00
	08.2023	MYR	22		5	0	0	0	0,00
	08.2023	PLN	16		4	0	0	0	0,00
	08.2023	SGD	11		8	0	0	0	0,00
SCX	07.2023	AUD	18		12	0	0	0	0,00
	07.2023	CHF	52		58	0	0	0	0,00
	07.2023	NZD	3		2	0	0	0	0,00
	07.2023	$	9	AUD	13	0	0	0	0,00
	07.2023		0	IDR	124	0	0	0	0,00
	08.2023	AUD	13	$	9	0	0	0	0,00
SOG	07.2023		27		18	0	0	0	0,00
	07.2023	€	192		206	0	(3)	(3)	0,00
	07.2023	HKD	554		71	0	0	0	0,00
	07.2023	$	10	ZAR	191	0	0	0	0,00
	08.2023	ZAR	192	$	10	0	0	0	0,00
TOR	07.2023	AUD	14		9	0	0	0	0,00
	07.2023	£	1.064		1.353	0	(1)	(1)	0,00
	07.2023	$	11	AUD	16	0	0	0	0,00
	07.2023		76	CAD	100	0	0	0	0,00
	07.2023		2	HUF	730	0	0	0	0,00
	07.2023		86	¥	12.314	0	0	0	0,00
	07.2023		3	NZD	5	0	0	0	0,00
	08.2023	AUD	16	$	11	0	0	0	0,00
	08.2023	CAD	100		76	0	0	0	0,00
	08.2023	HUF	735		2	0	0	0	0,00
	08.2023	¥	12.262		86	0	0	0	0,00
	08.2023	NZD	5		3	0	0	0	0,00
	08.2023	$	1.353	£	1.064	1	0	1	0,00
UAG	07.2023	AUD	3	$	2	0	0	0	0,00
	07.2023	CHF	3		4	0	0	0	0,00
	07.2023	CNY	101		14	0	0	0	0,00
	07.2023	CZK	0		0	0	0	0	0,00
	07.2023	IDR	87.279		6	0	0	0	0,00
	07.2023	KRW	37.973		29	0	0	0	0,00
	07.2023	NOK	22		2	0	0	0	0,00
	07.2023	SGD	1		1	0	0	0	0,00
	07.2023	$	17	AUD	26	0	0	0	0,00
	07.2023		1	CHF	1	0	0	0	0,00
	07.2023		3	PHP	147	0	0	0	0,00
	08.2023	AUD	26	$	17	0	0	0	0,00
	08.2023	CHF	1		1	0	0	0	0,00
	08.2023	PHP	148		3	0	0	0	0,00
						$ 115	$ (16)	$ 99	0,01

Summe Freiverkehrsfinanzderivate	**$ 16.517**	**2,47**
Summe Anlagen	**$ 804.155**	**120,28**
Sonstige Aktiva und Passiva	**$ (135.568)**	**(20,28)**
Nettovermögen	**$ 668.587**	**100,00**

ERLÄUTERUNGEN ZUR AUFSTELLUNG DES WERTPAPIERBESTANDS (Angaben in Tausend*):

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

^ **Das Wertpapier ist in Verzug.**

(a) **Bei dem Wertpapier handelt es sich um ein Interest Only- („IO“) bzw. IO-Strip.**

(b) **Wertpapier mit Sachwertausschüttung.**

(c) **Nullkuponwertpapier.**

(d) **Der Kupon stellt eine Rendite bis zur Endfälligkeit dar.**

(e) **Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.**

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

(g) **Mit dem Fonds verbunden.**

Barmittel in Höhe von 28.492 USD (31. Dezember 2022: 35.607 USD) wurden zum 30. Juni 2023 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Barmittel in Höhe von 900 USD (31. Dezember 2022: null USD) wurden zum 30. Juni 2023 gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. als Sicherheit für Finanzderivate verpfändet.

Beizulegender Zeitwert[1]

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 30. Juni 2023 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie[2]	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	$ 56.789	$ 467.029	$ 356	$ 524.174
Investmentfonds	236.945	0	0	236.945
Pensionsgeschäfte	0	18.513	0	18.513
Finanzderivate[3]	8.565	15.958	0	24.523
Summen	**$ 302.299**	**$ 501.500**	**$ 356**	**$ 804.155**

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

Kategorie[2]	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	$ 94.207	$ 379.228	$ 0	$ 473.435
Investmentfonds	151.214	100.275	0	251.489
Pensionsgeschäfte	0	18.536	0	18.536
Finanzderivate[3]	(15.794)	1.026	0	(14.768)
Summen	**$ 229.627**	**$ 499.065**	**$ 0**	**$ 728.692**

(1) Weitere Informationen finden Sie in den Erläuterungen in Erläuterung 3.

(2) Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung des Wertpapierbestands.

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

Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC-Finanzderivate und -Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2023 und 31. Dezember 2022:

	Zum 30. Jun. 2023			Zum 31. Dez. 2022		
Kontrahent	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-engagement[1]	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-engagement[1]
AZD	$ 1	$ 0	$ 1	$ k. A.	$ k. A.	$ k. A.
BOA	701	(410)	291	(3.503)	1.500	(2.003)
BOM	k. A.	k. A.	k. A.	2	0	2
BPS	2.978	(2.580)	398	485	(1.380)	(895)
BRC	8.857	(8.250)	607	(222)	450	228
BSH	k. A.	k. A.	k. A.	(1)	0	(1)
CBK	472	(300)	172	4.514	(4.480)	34
CLY	(20)	0	(20)	(53)	0	(53)
DUB	669	(500)	169	13	0	13
GLM	(550)	120	(430)	(829)	420	(409)
GST	(12)	10	(2)	15	(20)	(5)
JPM	(755)	590	(165)	(36)	(590)	(626)
MBC	1.572	(1.510)	62	1.039	(1.100)	(61)
MEI	k. A.	k. A.	k. A.	7	(440)	(433)
MYC	(73)	180	107	(27)	180	153
MYI	(51)	0	(51)	(55)	780	725
RBC	451	(320)	131	(57)	0	(57)
RYL	(29)	0	(29)	(21)	0	(21)
SAL	(24)	0	(24)	(18)	0	(18)
SCX	13	0	13	4.106	(3.980)	126
SOG	2.348	(1.670)	678	(81)	(280)	(361)
SSB	(53)	0	(53)	(463)	590	127
TOR	14	0	14	(838)	690	(148)
UAG	8	0	8	(549)	420	(129)

(1) Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären.

Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung des Wertpapierbestands zum 30. Juni 2023:

	30. Jun. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	31,35	25,87
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	47,06	35,98
Sonstige übertragbare Wertpapiere	k. A.	1,28
Investmentfonds	35,44	33,53
Pensionsgeschäfte	2,77	2,47
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	1,27	(2,13)
Zentral abgerechnete Finanzderivate	(0,08)	(0,30)
Freiverkehrsfinanzderivate	2,47	0,45

Das Anlageportfolio des Fonds konzentriert sich zum 30. Juni 2023 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	30. Jun. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
Unternehmensanleihen und Wechsel	3,30	3,39
Wandelanleihen & Wechsel	0,14	0,12
US-Regierungsbehörden	21,74	4,77
US-Schatzobligationen	7,17	1,20
Non-Agency-MBS	1,79	1,66
Forderungsbesicherte Wertpapiere	8,37	7,95
Staatsemissionen	6,26	7,97
Stammaktien	1,75	6,88
Vorzugswertpapiere	0,03	0,16
Real Estate Investment Trusts	6,75	5,86
Kurzfristige Instrumente	21,11	23,17
Investmentfonds	35,44	33,53
Pensionsgeschäfte	2,77	2,47
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	1,27	(2,13)
Verkaufsoptionen		
Optionen auf börsengehandelte Terminkontrakte	0,00	k. A.
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	0,00	(0,01)
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzkauf	(0,01)	0,00
Credit Default Swaps auf Kreditindizes— Schutzverkauf	0,02	0,07
Zinsswaps	(0,09)	(0,36)
Freiverkehrsfinanzderivate		
Verkaufsoptionen		
Inflation-Capped Options	(0,07)	(0,06)
Zinsswapoptionen	(0,02)	(0,01)
Credit Default Swaps auf Kreditindizes— Schutzverkauf	(0,02)	(0,01)
Zinsswaps	(0,03)	(0,04)
Total Return Swaps auf Indizes	(0,25)	0,05
Total Return Swaps auf Wertpapiere	k. A.	0,02
Devisenterminkontrakte	1,89	(0,87)
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	0,97	1,37
Sonstige Aktiva und Passiva	(20,28)	2,85
Nettovermögen	100,00	100,00

BESCHREIBUNG		PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE				
BELGIEN				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Ontex Group NV				
3,500 % fällig am 15.07.2026	€	7.500	$ 7.222	0,24
BERMUDAS				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
NCL Corp. Ltd.				
5,875 % fällig am 15.03.2026	$	2.850	2.669	0,09
5,875 % fällig am 15.02.2027		1.875	1.827	0,06
8,375 % fällig am 01.02.2028		3.000	3.138	0,10
Valaris Ltd.				
8,375 % fällig am 30.04.2030		3.100	3.113	0,10
Viking Cruises Ltd.				
5,875 % fällig am 15.09.2027		4.000	3.681	0,12
13,000 % fällig am 15.05.2025		2.000	2.101	0,07
VOC Escrow Ltd.				
5,000 % fällig am 15.02.2028		4.000	3.674	0,12
Summe Bermudas			20.203	0,66
KANADA				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Air Canada				
3,875 % fällig am 15.08.2026		3.250	3.015	0,10
4,625 % fällig am 15.08.2029	CAD	3.000	2.045	0,07
B.C. Unlimited Liability Co.				
3,500 % fällig am 15.02.2029	$	4.000	3.512	0,11
4,000 % fällig am 15.10.2030		10.000	8.570	0,28
4,375 % fällig am 15.01.2028		2.500	2.311	0,08
Bausch Health Cos., Inc.				
4,875 % fällig am 01.06.2028		3.500	2.088	0,07
5,500 % fällig am 01.11.2025		3.000	2.655	0,09
5,750 % fällig am 15.08.2027		2.500	1.535	0,05
Bombardier, Inc.				
7,125 % fällig am 15.06.2026		6.000	5.966	0,19
7,500 % fällig am 15.03.2025		1.253	1.257	0,04
7,500 % fällig am 01.02.2029		4.000	3.958	0,13
7,875 % fällig am 15.04.2027		3.000	2.996	0,10
Garda World Security Corp.				
7,750 % fällig am 15.02.2028		1.200	1.192	0,04
GFL Environmental, Inc.				
3,500 % fällig am 01.09.2028		5.000	4.455	0,14
4,000 % fällig am 01.08.2028		3.000	2.686	0,09
Intelligent Packaging Ltd. Finco, Inc.				
6,000 % fällig am 15.09.2028		800	681	0,02
Strathcona Resources Ltd.				
6,875 % fällig am 01.08.2026		875	767	0,02
Summe Kanada			49.689	1,62
CAYMAN INSELN				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Diamond Foreign Asset Co. (9,000 % bar oder 9,000 % PIK)				
9,000 % fällig am 22.04.2027 (b)(h)		66	64	0,00
9,000 % fällig am 22.04.2027 (b)		18	17	0,00
Spirit Loyalty Cayman Ltd.				
8,000 % fällig am 20.09.2025		5.000	5.042	0,16
Transocean, Inc.				
8,750 % fällig am 15.02.2030		2.250	2.286	0,08
UPCB Finance Ltd.				
3,625 % fällig am 15.06.2029	€	8.500	7.984	0,26
Wynn Macau Ltd.				
5,500 % fällig am 01.10.2027	$	4.000	3.565	0,12
Summe Cayman Inseln			18.958	0,62
TSCHECHISCHE REPUBLIK				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
EP Infrastructure A/S				
1,816 % fällig am 02.03.2031	€	28.500	21.854	0,71

BESCHREIBUNG		PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
FRANKREICH				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Altice France S.A.				
3,375 % fällig am 15.01.2028	€	7.000	$ 5.593	0,18
4,000 % fällig am 15.07.2029		3.000	2.357	0,08
4,125 % fällig am 15.01.2029		3.000	2.383	0,08
5,500 % fällig am 15.01.2028	$	20.100	15.202	0,49
5,500 % fällig am 15.10.2029		5.000	3.581	0,12
CAB SELAS				
3,375 % fällig am 01.02.2028	€	11.000	9.809	0,32
Chrome Bidco SASU				
3,500 % fällig am 31.05.2028		15.300	14.083	0,46
Chrome Holdco SASU				
5,000 % fällig am 31.05.2029		3.850	3.161	0,10
Electricite de France S.A.				
9,125 % fällig am 15.03.2033 (e)	$	26.800	27.550	0,90
Elior Group S.A.				
3,750 % fällig am 15.07.2026	€	2.900	2.626	0,08
Eramet S.A.				
7,000 % fällig am 22.05.2028		3.500	3.929	0,13
Renault S.A.				
2,500 % fällig am 01.04.2028		2.900	2.812	0,09
Rexel S.A.				
2,125 % fällig am 15.12.2028		2.600	2.494	0,08
Summe Frankreich			95.580	3,11
DEUTSCHLAND				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Cheplapharm Arzneimittel GmbH				
3,500 % fällig am 11.02.2027		3.000	2.980	0,10
4,375 % fällig am 15.01.2028		5.000	5.008	0,16
7,500 % fällig am 15.05.2030		950	1.043	0,03
CT Investment GmbH				
5,500 % fällig am 15.04.2026		8.700	8.833	0,29
Ctec GmbH				
5,250 % fällig am 15.02.2030		12.000	10.883	0,36
HO Verwaltungs GmbH (3,750 % bar oder 4,500 % PIK)				
3,750 % fällig am 15.09.2026 (b)		4.000	4.083	0,13
HO Verwaltungs GmbH (3,875 % bar oder 4,625 % PIK)				
3,875 % fällig am 15.05.2027 (b)		2.000	1.976	0,06
HO Verwaltungs GmbH (4,750 % bar oder 5,500 % PIK)				
4,750 % fällig am 15.09.2026 (b)	$	5.000	4.618	0,15
Nidda Healthcare Holding GmbH				
7,500 % fällig am 21.08.2026	€	22.250	24.213	0,79
Techem Verwaltungsgesellschaft mbH				
2,000 % fällig am 15.07.2025		10.000	10.398	0,34
TK Elevator Midco GmbH				
4,375 % fällig am 15.07.2027		14.400	14.098	0,46
WEPA Hygieneprodukte GmbH				
2,875 % fällig am 15.12.2027		8.000	7.580	0,25
ZF Finance GmbH				
2,250 % fällig am 03.05.2028		5.000	4.608	0,15
3,750 % fällig am 21.09.2028		4.000	3.938	0,13
Summe Deutschland			104.259	3,40
IRLAND				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Motion Bondco DAC				
4,500 % fällig am 15.11.2027		3.000	2.874	0,09
6,625 % fällig am 15.11.2027	$	5.000	4.582	0,15
Summe Irland			7.456	0,24
ITALIEN				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Banca Monte dei Paschi di Siena SpA				
7,677 % fällig am 18.01.2028	€	2.000	1.839	0,06
8,000 % fällig am 22.01.2030		2.000	1.962	0,06
10,500 % fällig am 23.07.2029		3.000	3.255	0,11
FIS Fabbrica Italiana Sintetici SpA				
5,625 % fällig am 01.08.2027		5.800	5.669	0,18
IMA Industria Macchine Automatiche SpA				
3,750 % fällig am 15.01.2028		12.000	11.514	0,37
Inter Media and Communication SpA				
6,750 % fällig am 09.02.2027		3.000	3.173	0,10

BESCHREIBUNG		PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
Intesa Sanpaolo SpA				
4,198 % fällig am 01.06.2032	$	1.000	$ 746	0,02
4,950 % fällig am 01.06.2042		2.000	1.319	0,04
5,710 % fällig am 15.01.2026		5.000	4.763	0,16
5,875 % fällig am 01.09.2031 (e)(g)	€	5.000	4.354	0,14
7,700 % fällig am 17.09.2025 (e)(g)	$	7.000	6.589	0,21
7,750 % fällig am 11.01.2027 (e)(g)	€	4.000	4.227	0,14
Italmatch Chemicals SpA				
9,098 % fällig am 06.02.2028		2.147	2.217	0,07
10,000 % fällig am 06.02.2028		500	533	0,02
Mundys SpA				
1,625 % fällig am 03.02.2025		2.000	2.086	0,07
1,875 % fällig am 13.07.2027		10.000	9.677	0,32
1,875 % fällig am 12.02.2028		12.500	11.661	0,38
Nexi SpA				
1,625 % fällig am 30.04.2026		8.000	7.975	0,26
2,125 % fällig am 30.04.2029 (i)		21.200	19.336	0,63
Shiba BidCo SpA				
4,500 % fällig am 31.10.2028		5.000	4.848	0,16
Telecom Italia SpA				
1,625 % fällig am 18.01.2029		5.000	4.201	0,14
5,303 % fällig am 30.05.2024	$	2.000	1.946	0,06
UniCredit SpA				
3,875 % fällig am 03.06.2027 (e)(g)	€	4.000	3.301	0,11
5,459 % fällig am 30.06.2035	$	14.000	11.892	0,39
Summe Italien			129.083	4,20
JERSEY, KANALINSELN				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Adient Global Holdings Ltd.				
3,500 % fällig am 15.08.2024	€	747	801	0,03
4,875 % fällig am 15.08.2026	$	1.000	951	0,03
G City Europe Ltd.				
4,250 % fällig am 11.09.2025	€	2.000	1.909	0,06
Summe Jersey, Kanalinseln			3.661	0,12
LIBERIA				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Royal Caribbean Cruises Ltd.				
4,250 % fällig am 01.07.2026	$	5.000	4.594	0,15
5,375 % fällig am 15.07.2027		5.400	5.055	0,16
5,500 % fällig am 31.08.2026		10.000	9.491	0,31
5,500 % fällig am 01.04.2028		7.800	7.282	0,24
7,250 % fällig am 15.01.2030		3.000	3.041	0,10
11,500 % fällig am 01.06.2025		2.867	3.044	0,10
Summe Liberia			32.507	1,06
LUXEMBURG				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Albion Financing SARL				
6,125 % fällig am 15.10.2026		6.125	5.764	0,19
Altice Financing S.A.				
3,000 % fällig am 15.01.2028	€	6.000	5.083	0,17
5,750 % fällig am 15.08.2029	$	5.000	3.879	0,13
Altice France Holding S.A.				
4,000 % fällig am 15.02.2028	€	4.000	2.163	0,07
Aramark International Finance SARL				
3,125 % fällig am 01.04.2025		5.000	5.269	0,17
BK LC Lux Finco SARL				
5,250 % fällig am 30.04.2029		5.000	5.140	0,17
Camelot Finance S.A.				
4,500 % fällig am 01.11.2026	$	4.750	4.479	0,15
Cidron Aida Finco SARL				
5,000 % fällig am 01.04.2028	€	17.500	17.327	0,56
Cirsa Finance International SARL				
4,500 % fällig am 15.03.2027		14.000	14.017	0,46
Herens Holdco SARL				
4,750 % fällig am 15.05.2028	$	2.100	1.630	0,05
Herens Midco SARL				
5,250 % fällig am 15.05.2029	€	11.800	7.473	0,24
InPost S.A.				
2,250 % fällig am 15.07.2027		2.925	2.782	0,09
LHMC Finco 2 SARL (7,250 % bar oder 8,000 % PIK)				
7,250 % fällig am 02.10.2025 (b)		3.796	4.097	0,13

BESCHREIBUNG		PAR (000S)		MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
Loarre Investments SARL					
6,500 % fällig am 15.05.2029	€	5.000	$	5.193	0,17
Monitchem HoldCo 3 S.A.					
8,750 % fällig am 01.05.2028		700		756	0,03
Summer BC Holdco SARL					
5,750 % fällig am 31.10.2026		4.000		3.892	0,13
9,250 % fällig am 31.10.2027		3.154		2.843	0,09
Telecom Italia Capital S.A.					
6,375 % fällig am 15.11.2033	$	7.000		5.945	0,19
7,200 % fällig am 18.07.2036		3.000		2.582	0,08
Summe Luxemburg				100.314	3,27
MULTINATIONAL					
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL					
Allied Universal Holdco LLC					
3,625 % fällig am 01.06.2028	€	6.000		5.259	0,17
4,875 % fällig am 01.06.2028	£	4.250		4.219	0,14
American Airlines, Inc.					
5,500 % fällig am 20.04.2026	$	16.300		16.163	0,53
5,750 % fällig am 20.04.2029		10.800		10.496	0,34
Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC					
3,000 % fällig am 01.09.2029	€	3.075		2.506	0,08
3,250 % fällig am 01.09.2028	$	3.000		2.580	0,08
4,000 % fällig am 01.09.2029		1.000		793	0,03
Clarios Global LP					
4,375 % fällig am 15.05.2026	€	10.000		10.431	0,34
Connect Finco SARL					
6,750 % fällig am 01.10.2026	$	5.000		4.861	0,16
Paysafe Finance PLC					
3,000 % fällig am 15.06.2029	€	1.875		1.590	0,05
4,000 % fällig am 15.06.2029	$	4.500		3.542	0,11
Summe multinational				62.440	2,03
NIEDERLANDE					
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL					
Ashland Services BV					
2,000 % fällig am 30.01.2028	€	15.000		13.942	0,45
Axalta Coating Systems Dutch Holding BV					
3,750 % fällig am 15.01.2025		10.000		10.743	0,35
Clear Channel International BV					
6,625 % fällig am 01.08.2025	$	3.000		2.989	0,10
Diamond BC BV					
4,625 % fällig am 01.10.2029		12.000		12.113	0,40
Dufry One BV					
2,000 % fällig am 15.02.2027 (i)	€	14.250		13.602	0,44
3,375 % fällig am 15.04.2028		10.000		9.690	0,32
Energizer Gamma Acquisition BV					
3,500 % fällig am 30.06.2029		5.000		4.412	0,14
IPD 3 BV					
8,000 % fällig am 15.06.2028		1.200		1.339	0,04
LeasePlan Corp. NV					
7,375 % fällig am 29.05.2024 (e)(g)		7.000		7.508	0,25
OI European Group BV					
6,250 % fällig am 15.05.2028		800		894	0,03
Q-Park Holding BV					
1,500 % fällig am 01.03.2025		4.000		4.196	0,14
2,000 % fällig am 01.03.2027		7.000		6.551	0,21
Sensata Technologies BV					
5,000 % fällig am 01.10.2025	$	1.000		980	0,03
Trivium Packaging Finance BV					
3,750 % fällig am 15.08.2026	€	5.000		5.050	0,16
United Group BV					
3,125 % fällig am 15.02.2026		5.000		4.775	0,16
3,625 % fällig am 15.02.2028		18.830		16.350	0,53
4,000 % fällig am 15.11.2027		1.500		1.347	0,04
UPC Holding BV					
3,875 % fällig am 15.06.2029		8.000		7.028	0,23
ZF Europe Finance BV					
2,000 % fällig am 23.02.2026		3.000		2.985	0,10
3,000 % fällig am 23.10.2029		5.600		5.170	0,17
Ziggo Bond Co. BV					
3,375 % fällig am 28.02.2030		5.000		4.032	0,13
6,000 % fällig am 15.01.2027	$	2.500		2.298	0,08
Ziggo BV					
2,875 % fällig am 15.01.2030	€	5.000		4.412	0,14
Summe Niederlande				142.406	4,64

BESCHREIBUNG		PAR (000S)		MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
NORWEGEN					
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL					
Adevinta ASA					
2,625 % fällig am 15.11.2025	€	7.000	$	7.340	0,24
3,000 % fällig am 15.11.2027		2.750		2.797	0,09
Summe Norwegen				10.137	0,33
PANAMA					
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL					
Carnival Corp.					
4,000 % fällig am 01.08.2028	$	7.000		6.212	0,20
5,750 % fällig am 01.03.2027		10.000		9.215	0,30
6,000 % fällig am 01.05.2029		2.000		1.788	0,06
7,625 % fällig am 01.03.2026		3.000		2.941	0,10
Summe Panama				20.156	0,66
SPANIEN					
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL					
Cellnex Finance Co. S.A.					
2,000 % fällig am 15.09.2032	€	10.000		8.607	0,28
2,000 % fällig am 15.02.2033		3.000		2.554	0,08
3,875 % fällig am 07.07.2041	$	2.400		1.761	0,06
Cellnex Telecom S.A.					
1,000 % fällig am 20.04.2027	€	4.100		3.925	0,13
1,875 % fällig am 26.06.2029		5.000		4.615	0,15
Grifols Escrow Issuer S.A.					
3,875 % fällig am 15.10.2028		14.800		13.857	0,45
Grifols S.A.					
2,250 % fällig am 15.11.2027		5.000		4.951	0,16
3,200 % fällig am 01.05.2025		6.500		6.918	0,23
Kaixo Bondco Telecom S.A.					
5,125 % fällig am 30.09.2029		7.000		6.671	0,22
Lorca Telecom Bondco S.A.					
4,000 % fällig am 18.09.2027		14.000		13.968	0,45
Summe Spanien				67.827	2,21
SCHWEDEN					
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL					
Dometic Group AB					
2,000 % fällig am 29.09.2028		5.000		4.418	0,14
Intrum AB					
3,000 % fällig am 15.09.2027		7.500		5.683	0,19
3,500 % fällig am 15.07.2026		2.000		1.630	0,05
9,250 % fällig am 15.03.2028 (i)		3.584		3.318	0,11
Verisure Holding AB					
3,250 % fällig am 15.02.2027		10.000		9.720	0,32
Verisure Midholding AB					
5,250 % fällig am 15.02.2029		2.650		2.513	0,08
Summe Schweden				27.282	0,89
GROSSBRITANNIEN					
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL					
BCP Modular Services Finance PLC					
4,750 % fällig am 30.11.2028		10.000		9.327	0,30
6,750 % fällig am 30.11.2029		8.000		6.655	0,22
Bellis Acquisition Co. PLC					
3,250 % fällig am 16.02.2026	£	10.000		10.671	0,35
Carnival PLC					
1,000 % fällig am 28.10.2029	€	8.000		5.490	0,18
Harbour Energy PLC					
5,500 % fällig am 15.10.2026	$	2.100		1.933	0,06
Heathrow Finance PLC					
4,125 % fällig am 01.09.2029	£	3.333		3.441	0,11
INEOS Finance PLC					
2,875 % fällig am 01.05.2026	€	5.000		5.015	0,16
INEOS Quattro Finance PLC					
2,500 % fällig am 15.01.2026		4.000		3.920	0,13
3,750 % fällig am 15.07.2026		2.475		2.385	0,08
International Game Technology PLC					
2,375 % fällig am 15.04.2028		8.000		7.842	0,26
6,500 % fällig am 15.02.2025	$	1.133		1.134	0,04
Lloyds Banking Group PLC					
7,500 % fällig am 27.06.2024 (e)(g)		6.000		5.737	0,19

BESCHREIBUNG		PAR (000S)		MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
Market Bidco Finco PLC					
5,500 % fällig am 04.11.2027	£	10.300	$	10.230	0,33
Marks & Spencer PLC					
3,750 % fällig am 19.05.2026		100		115	0,00
PEU Fin PLC					
7,250 % fällig am 01.07.2028	€	1.200		1.312	0,04
Rolls-Royce PLC					
0,875 % fällig am 09.05.2024		3.000		3.174	0,10
4,625 % fällig am 16.02.2026		2.500		2.688	0,09
5,750 % fällig am 15.10.2027	£	4.000		4.728	0,15
Thames Water Kemble Finance PLC					
4,625 % fällig am 19.05.2026		850		562	0,02
Virgin Media Secured Finance PLC					
4,250 % fällig am 15.01.2030		20.000		20.072	0,65
Vmed O2 UK Financing PLC					
3,250 % fällig am 31.01.2031	€	10.750		9.662	0,32
4,750 % fällig am 15.07.2031	$	6.250		5.203	0,17
Vodafone Group PLC					
7,000 % fällig am 04.04.2079		4.000		4.109	0,13
Zenith Finco PLC					
6,500 % fällig am 30.06.2027	£	3.000		2.912	0,10
Summe Großbritannien				128.317	4,18
USA					
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL					
Academy Ltd.					
6,000 % fällig am 15.11.2027	$	5.000		4.806	0,16
Acadia Healthcare Co., Inc.					
5,000 % fällig am 15.04.2029		5.000		4.615	0,15
AdaptHealth LLC					
5,125 % fällig am 01.03.2030		1.000		811	0,03
6,125 % fällig am 01.08.2028		2.000		1.735	0,06
ADT Security Corp.					
4,875 % fällig am 15.07.2032		4.000		3.426	0,11
Advantage Sales & Marketing, Inc.					
6,500 % fällig am 15.11.2028		7.000		5.926	0,19
Albertsons Cos., Inc.					
3,500 % fällig am 15.03.2029		5.000		4.333	0,14
4,625 % fällig am 15.01.2027		2.000		1.897	0,06
6,500 % fällig am 15.02.2028		5.000		5.014	0,16
Allegiant Travel Co.					
7,250 % fällig am 15.08.2027		10.500		10.472	0,34
Allison Transmission, Inc.					
3,750 % fällig am 30.01.2031		2.000		1.691	0,06
4,750 % fällig am 01.10.2027		2.000		1.886	0,06
AMC Networks, Inc.					
4,250 % fällig am 15.02.2029		7.000		3.771	0,12
4,750 % fällig am 01.08.2025		8.300		7.267	0,24
American Airlines Pass-Through Trust					
3,375 % fällig am 01.11.2028		300		270	0,01
American Airlines, Inc.					
7,250 % fällig am 15.02.2028		900		896	0,03
American Builders & Contractors Supply Co., Inc.					
3,875 % fällig am 15.11.2029		4.500		3.848	0,13
4,000 % fällig am 15.01.2028		10.000		9.123	0,30
Amsted Industries, Inc.					
4,625 % fällig am 15.05.2030		5.000		4.465	0,15
AmWINS Group, Inc.					
4,875 % fällig am 30.06.2029		5.000		4.520	0,15
ANGI Group LLC					
3,875 % fällig am 15.08.2028		2.000		1.635	0,05
Antero Midstream Partners LP					
5,375 % fällig am 15.06.2029		5.000		4.651	0,15
Antero Resources Corp.					
5,375 % fällig am 01.03.2030		4.000		3.707	0,12
Apache Corp.					
4,875 % fällig am 15.11.2027		5.000		4.645	0,15
APi Group DE, Inc.					
4,750 % fällig am 15.10.2029		3.000		2.705	0,09
Aramark Services, Inc.					
5,000 % fällig am 01.02.2028		3.000		2.832	0,09
Ascent Resources Utica Holdings LLC					
5,875 % fällig am 30.06.2029		3.000		2.680	0,09
ASP Unifrax Holdings, Inc.					
5,250 % fällig am 30.09.2028		5.000		3.616	0,12
7,500 % fällig am 30.09.2029		2.000		1.240	0,04

BESCHREIBUNG		PAR (000S)		MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
Avantor Funding, Inc.					
3,875 % fällig am 15.07.2028	€	4.750	$	4.762	0,16
4,625 % fällig am 15.07.2028	$	2.500		2.320	0,08
Ball Corp.					
1,500 % fällig am 15.03.2027	€	5.000		4.892	0,16
2,875 % fällig am 15.08.2030	$	7.500		6.233	0,20
3,125 % fällig am 15.09.2031		4.000		3.295	0,11
Bath & Body Works, Inc.					
6,625 % fällig am 01.10.2030		4.000		3.866	0,13
6,875 % fällig am 01.11.2035		7.000		6.416	0,21
BCPE Empire Holdings, Inc.					
7,625 % fällig am 01.05.2027		12.000		11.173	0,36
Black Knight InfoServ LLC					
3,625 % fällig am 01.09.2028		5.000		4.488	0,15
Blue Racer Midstream LLC					
7,625 % fällig am 15.12.2025		5.000		5.059	0,17
Boxer Parent Co., Inc.					
6,500 % fällig am 02.10.2025	€	3.000		3.239	0,11
Boyd Gaming Corp.					
4,750 % fällig am 01.12.2027	$	2.000		1.897	0,06
4,750 % fällig am 15.06.2031		4.000		3.578	0,12
Boyne USA, Inc.					
4,750 % fällig am 15.05.2029		5.000		4.510	0,15
Buckeye Partners LP					
4,125 % fällig am 01.03.2025		3.000		2.857	0,09
4,500 % fällig am 01.03.2028		2.500		2.242	0,07
Builders FirstSource, Inc.					
4,250 % fällig am 01.02.2032		3.000		2.614	0,09
5,000 % fällig am 01.03.2030		5.000		4.680	0,15
Burford Capital Global Finance LLC					
9,250 % fällig am 01.07.2031		5.650		5.622	0,18
Caesars Entertainment, Inc.					
4,625 % fällig am 15.10.2029		5.925		5.179	0,17
6,250 % fällig am 01.07.2025		5.000		4.981	0,16
7,000 % fällig am 15.02.2030		5.000		5.026	0,16
Callon Petroleum Co.					
7,500 % fällig am 15.06.2030		3.000		2.834	0,09
Calpine Corp.					
3,750 % fällig am 01.03.2031		2.000		1.622	0,05
4,500 % fällig am 15.02.2028		4.000		3.625	0,12
4,625 % fällig am 01.02.2029		1.500		1.267	0,04
5,125 % fällig am 15.03.2028		4.000		3.575	0,12
5,250 % fällig am 01.06.2026		663		641	0,02
Capstone Borrower, Inc.					
8,000 % fällig am 15.06.2030		3.100		3.064	0,10
Catalent Pharma Solutions, Inc.					
2,375 % fällig am 01.03.2028	€	20.000		17.658	0,58
5,000 % fällig am 15.07.2027	$	1.000		919	0,03
CCO Holdings LLC					
4,250 % fällig am 01.02.2031		5.000		4.049	0,13
4,250 % fällig am 15.01.2034		7.000		5.298	0,17
4,500 % fällig am 15.08.2030		10.000		8.336	0,27
4,500 % fällig am 01.05.2032		10.000		7.994	0,26
4,500 % fällig am 01.06.2033		5.000		3.932	0,13
4,750 % fällig am 01.03.2030		7.000		5.992	0,20
5,125 % fällig am 01.05.2027		9.000		8.390	0,27
5,375 % fällig am 01.06.2029		3.500		3.168	0,10
CDI Escrow Issuer, Inc.					
5,750 % fällig am 01.04.2030		3.750		3.494	0,11
Central Garden & Pet Co.					
4,125 % fällig am 30.04.2031		4.000		3.303	0,11
Charles River Laboratories International, Inc.					
3,750 % fällig am 15.03.2029		2.000		1.762	0,06
4,000 % fällig am 15.03.2031		1.000		870	0,03
Chesapeake Energy Corp.					
5,500 % fällig am 01.02.2026		2.000		1.952	0,06
5,875 % fällig am 01.02.2029		1.500		1.426	0,05
6,750 % fällig am 15.04.2029		12.000		11.918	0,39
Churchill Downs, Inc.					
6,750 % fällig am 01.05.2031		5.000		4.950	0,16
Clarivate Science Holdings Corp.					
3,875 % fällig am 01.07.2028		3.750		3.328	0,11
4,875 % fällig am 01.07.2029		4.000		3.553	0,12
Clearway Energy Operating LLC					
3,750 % fällig am 15.01.2032		5.000		4.078	0,13
4,750 % fällig am 15.03.2028		2.000		1.847	0,06

BESCHREIBUNG		PAR (000S)		MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
Cloud Software Group, Inc.					
6,500 % fällig am 31.03.2029		8.000		7.131	0,23
Coinbase Global, Inc.					
3,375 % fällig am 01.10.2028	$	1.000	$	670	0,02
3,625 % fällig am 01.10.2031		1.000		592	0,02
CommScope, Inc.					
4,750 % fällig am 01.09.2029		7.500		5.920	0,19
6,000 % fällig am 01.03.2026		2.000		1.866	0,06
Community Health Systems, Inc.					
4,750 % fällig am 15.02.2031		5.000		3.784	0,12
5,250 % fällig am 15.05.2030		5.000		3.944	0,13
5,625 % fällig am 15.03.2027		8.000		7.058	0,23
6,000 % fällig am 15.01.2029		1.625		1.369	0,04
6,875 % fällig am 15.04.2029		3.000		1.877	0,06
Comstock Resources, Inc.					
5,875 % fällig am 15.01.2030		2.000		1.739	0,06
6,750 % fällig am 01.03.2029		4.000		3.664	0,12
CoreLogic, Inc.					
4,500 % fällig am 01.05.2028		7.000		5.651	0,18
Coty, Inc.					
3,875 % fällig am 15.04.2026	€	7.750		8.216	0,27
5,000 % fällig am 15.04.2026	$	1.000		959	0,03
Covanta Holding Corp.					
4,875 % fällig am 01.12.2029		3.000		2.599	0,09
5,000 % fällig am 01.09.2030		3.000		2.551	0,08
Credit Suisse AG AT1 Claim ^		4.900		196	0,01
Crestwood Midstream Partners LP					
7,375 % fällig am 01.02.2031		4.000		3.947	0,13
Crocs, Inc.					
4,125 % fällig am 15.08.2031		4.000		3.236	0,11
Crown Americas LLC					
4,250 % fällig am 30.09.2026		5.000		4.739	0,15
4,750 % fällig am 01.02.2026		2.000		1.940	0,06
CrownRock LP					
5,000 % fällig am 01.05.2029		2.000		1.876	0,06
5,625 % fällig am 15.10.2025		5.000		4.932	0,16
CSC Holdings LLC					
3,375 % fällig am 15.02.2031		5.000		3.389	0,11
4,125 % fällig am 01.12.2030		5.000		3.502	0,11
5,500 % fällig am 15.04.2027		2.000		1.667	0,05
Curo Group Holdings Corp.					
7,500 % fällig am 01.08.2028		2.600		985	0,03
DaVita, Inc.					
3,750 % fällig am 15.02.2031		7.000		5.606	0,18
4,625 % fällig am 01.06.2030		12.000		10.315	0,34
Diamond Offshore Drilling, Inc.					
13,000 % fällig am 21.12.2026		44		43	0,00
Diamond Sports Group LLC					
5,375 % fällig am 15.08.2026 ^		6.000		206	0,01
Directv Financing LLC					
5,875 % fällig am 15.08.2027		12.500		11.335	0,37
DISH DBS Corp.					
5,250 % fällig am 01.12.2026		6.750		5.427	0,18
5,750 % fällig am 01.12.2028		5.000		3.728	0,12
5,875 % fällig am 15.11.2024		5.000		4.379	0,14
7,750 % fällig am 01.07.2026		5.000		3.072	0,10
DISH Network Corp.					
11,750 % fällig am 15.11.2027		5.000		4.885	0,16
DT Midstream, Inc.					
4,125 % fällig am 15.06.2029		5.000		4.393	0,14
4,375 % fällig am 15.06.2031		4.000		3.451	0,11
Edgewell Personal Care Co.					
4,125 % fällig am 01.04.2029		4.000		3.495	0,11
5,500 % fällig am 01.06.2028		5.000		4.732	0,15
Elanco Animal Health, Inc.					
6,650 % fällig am 28.08.2028		5.000		4.864	0,16
Element Solutions, Inc.					
3,875 % fällig am 01.09.2028		5.000		4.367	0,14
Emerald Debt Merger Sub LLC					
6,625 % fällig am 15.12.2030		6.425		6.377	0,21
Encino Acquisition Partners Holdings LLC					
8,500 % fällig am 01.05.2028		2.184		1.984	0,06
Endeavor Energy Resources LP					
5,750 % fällig am 30.01.2028		10.000		9.791	0,32
EnLink Midstream LLC					
5,375 % fällig am 01.06.2029		7.500		7.152	0,23
5,625 % fällig am 15.01.2028		1.000		969	0,03

BESCHREIBUNG		PAR (000S)		MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
6,500 % fällig am 01.09.2030		1.750		1.750	0,06
EQM Midstream Partners LP					
4,000 % fällig am 01.08.2024	$	1.871	$	1.832	0,06
4,500 % fällig am 15.01.2029		10.550		9.421	0,31
4,750 % fällig am 15.01.2031		5.050		4.430	0,14
6,000 % fällig am 01.07.2025		735		728	0,02
6,500 % fällig am 01.07.2027		2.000		1.975	0,06
6,500 % fällig am 15.07.2048		4.000		3.624	0,12
7,500 % fällig am 01.06.2027		1.000		1.011	0,03
7,500 % fällig am 01.06.2030		2.000		2.026	0,07
Fertitta Entertainment LLC					
4,625 % fällig am 15.01.2029		2.000		1.757	0,06
6,750 % fällig am 15.01.2030		2.500		2.130	0,07
First Student Bidco, Inc.					
4,000 % fällig am 31.07.2029		5.000		4.241	0,14
Ford Motor Co.					
3,250 % fällig am 12.02.2032		6.125		4.824	0,16
6,100 % fällig am 19.08.2032		4.250		4.123	0,13
Ford Motor Credit Co. LLC					
2,700 % fällig am 10.08.2026		8.000		7.150	0,23
2,900 % fällig am 16.02.2028		5.000		4.287	0,14
2,900 % fällig am 10.02.2029		4.000		3.314	0,11
3,375 % fällig am 13.11.2025		5.000		4.654	0,15
4,000 % fällig am 13.11.2030		12.000		10.266	0,33
4,125 % fällig am 17.08.2027		5.000		4.570	0,15
4,134 % fällig am 04.08.2025		6.000		5.696	0,19
4,174 % fällig am 01.12.2024	€	5.000		5.390	0,18
4,542 % fällig am 01.08.2026	$	3.000		2.823	0,09
6,950 % fällig am 10.06.2026		5.000		5.030	0,16
7,200 % fällig am 10.06.2030		5.000		5.051	0,16
Fortrea Holdings, Inc.					
7,500 % fällig am 01.07.2030		2.000		2.050	0,07
Fortress Transportation & Infrastructure Investors LLC					
5,500 % fällig am 01.05.2028		2.950		2.703	0,09
6,500 % fällig am 01.10.2025		1.287		1.269	0,04
Frontier Communications Holdings LLC					
5,000 % fällig am 01.05.2028		2.500		2.159	0,07
5,875 % fällig am 15.10.2027		3.000		2.756	0,09
6,750 % fällig am 01.05.2029		3.000		2.330	0,08
Gap, Inc.					
3,625 % fällig am 01.10.2029		3.500		2.477	0,08
3,875 % fällig am 01.10.2031		4.000		2.743	0,09
Gartner, Inc.					
3,625 % fällig am 15.06.2029		4.000		3.525	0,12
3,750 % fällig am 01.10.2030		2.000		1.744	0,06
4,500 % fällig am 01.07.2028		2.000		1.870	0,06
Genesis Energy LP					
6,250 % fällig am 15.05.2026		2.000		1.902	0,06
6,500 % fällig am 01.10.2025		2.000		1.972	0,06
8,875 % fällig am 15.04.2030		700		685	0,02
Go Daddy Operating Co. LLC					
3,500 % fällig am 01.03.2029		5.000		4.289	0,14
GoTo Group, Inc.					
5,500 % fällig am 01.09.2027		2.000		1.103	0,04
Graphic Packaging International LLC					
2,625 % fällig am 01.02.2029	€	1.000		963	0,03
3,500 % fällig am 01.03.2029	$	2.500		2.189	0,07
Greystar Real Estate Partners LLC					
5,750 % fällig am 01.12.2025		6.000		5.864	0,19
HAT Holdings LLC					
3,375 % fällig am 15.06.2026		5.400		4.845	0,16
3,750 % fällig am 15.09.2030		4.300		3.378	0,11
HealthEquity, Inc.					
4,500 % fällig am 01.10.2029		2.000		1.765	0,06
Hertz Corp.					
4,625 % fällig am 01.12.2026		1.000		903	0,03
5,000 % fällig am 01.12.2029		3.000		2.484	0,08
Hilton Domestic Operating Co., Inc.					
3,625 % fällig am 15.02.2032		2.000		1.669	0,05
3,750 % fällig am 01.05.2029		3.500		3.110	0,10
4,000 % fällig am 01.05.2031		3.000		2.608	0,09
5,750 % fällig am 01.05.2028		1.500		1.478	0,05
Hilton Grand Vacations Borrower Escrow LLC					
4,875 % fällig am 01.07.2031		5.000		4.200	0,14
5,000 % fällig am 01.06.2029		4.000		3.554	0,12
Hilton Worldwide Finance LLC					
4,875 % fällig am 01.04.2027		2.500		2.427	0,08
Hologic, Inc.					
3,250 % fällig am 15.02.2029		4.000		3.503	0,11
4,625 % fällig am 01.02.2028		5.000		4.716	0,15

BESCHREIBUNG		PAR (000S)		MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
Howard Hughes Corp.					
4,125 % fällig am 01.02.2029	$	4.000	$	3.314	0,11
4,375 % fällig am 01.02.2031		3.000		2.397	0,08
5,375 % fällig am 01.08.2028		1.000		891	0,03
Howard Midstream Energy Partners LLC					
6,750 % fällig am 01.01.2027		450		429	0,01
8,875 % fällig am 15.07.2028 (a)		5.775		5.811	0,19
Howmet Aerospace, Inc.					
5,950 % fällig am 01.02.2037		3.000		3.058	0,10
iHeartCommunications, Inc.					
4,750 % fällig am 15.01.2028		5.000		3.776	0,12
5,250 % fällig am 15.08.2027		3.000		2.298	0,08
Imola Merger Corp.					
4,750 % fällig am 15.05.2029		7.500		6.530	0,21
IQVIA, Inc.					
2,250 % fällig am 15.01.2028	€	10.000		9.653	0,31
2,250 % fällig am 15.03.2029		5.900		5.515	0,18
2,875 % fällig am 15.06.2028		7.000		6.898	0,23
5,000 % fällig am 15.05.2027	$	2.000		1.926	0,06
Jeld-Wen, Inc.					
4,625 % fällig am 15.12.2025		1.000		970	0,03
4,875 % fällig am 15.12.2027		2.000		1.774	0,06
6,250 % fällig am 15.05.2025		2.000		2.019	0,07
Kaiser Aluminum Corp.					
4,500 % fällig am 01.06.2031		2.000		1.597	0,05
4,625 % fällig am 01.03.2028		4.000		3.504	0,11
KFC Holding Co.					
4,750 % fällig am 01.06.2027		3.500		3.382	0,11
Kinetik Holdings LP					
5,875 % fällig am 15.06.2030		3.000		2.854	0,09
Kronos International, Inc.					
3,750 % fällig am 15.09.2025	€	8.200		8.185	0,27
LABL, Inc.					
5,875 % fällig am 01.11.2028	$	2.500		2.278	0,07
6,750 % fällig am 15.07.2026		5.000		4.921	0,16
Lamb Weston Holdings, Inc.					
4,125 % fällig am 31.01.2030		2.000		1.789	0,06
4,875 % fällig am 15.05.2028		2.000		1.917	0,06
Legacy LifePoint Health LLC					
4,375 % fällig am 15.02.2027		4.000		3.100	0,10
Legends Hospitality Holding Co. LLC					
5,000 % fällig am 01.02.2026		1.750		1.577	0,05
Lehman Brothers Holdings, Inc.					
0,000 % fällig am 25.05.2010 ^		14.200		32	0,00
Level 3 Financing, Inc.					
3,625 % fällig am 15.01.2029		2.000		1.202	0,04
3,750 % fällig am 15.07.2029		3.000		1.810	0,06
4,250 % fällig am 01.07.2028		5.000		3.225	0,11
LFS Topco LLC					
5,875 % fällig am 15.10.2026		2.500		2.199	0,07
Lindblad Expeditions LLC					
6,750 % fällig am 15.02.2027		2.800		2.670	0,09
Live Nation Entertainment, Inc.					
6,500 % fällig am 15.05.2027		4.000		4.025	0,13
Madison IAQ LLC					
4,125 % fällig am 30.06.2028		8.000		7.052	0,23
Marriott Ownership Resorts, Inc.					
4,500 % fällig am 15.06.2029		2.000		1.728	0,06
Mattel, Inc.					
3,750 % fällig am 01.04.2029		3.000		2.642	0,09
5,875 % fällig am 15.12.2027		5.000		4.915	0,16
Mauser Packaging Solutions Holding Co.					
7,875 % fällig am 15.08.2026		6.000		5.968	0,19
Medline Borrower LP					
3,875 % fällig am 01.04.2029		13.500		11.745	0,38
5,250 % fällig am 01.10.2029		18.500		16.071	0,52
MGM Resorts International					
4,625 % fällig am 01.09.2026		5.000		4.720	0,15
5,750 % fällig am 15.06.2025		1.000		992	0,03
Michaels Cos., Inc.					
5,250 % fällig am 01.05.2028		3.750		3.034	0,10
Midcap Financial Issuer Trust					
6,500 % fällig am 01.05.2028		4.000		3.565	0,12
Midwest Gaming Borrower LLC					
4,875 % fällig am 01.05.2029		6.000		5.304	0,17

BESCHREIBUNG		PAR (000S)		MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
Moog, Inc.					
4,250 % fällig am 15.12.2027		4.000		3.705	0,12
MPH Acquisition Holdings LLC					
5,500 % fällig am 01.09.2028	$	5.000	$	4.268	0,14
5,750 % fällig am 01.11.2028		5.000		3.769	0,12
MPT Operating Partnership LP					
0,993 % fällig am 15.10.2026	€	3.300		2.739	0,09
2,500 % fällig am 24.03.2026	£	2.125		2.122	0,07
Nabors Industries, Inc.					
7,375 % fällig am 15.05.2027	$	2.750		2.619	0,09
Nationstar Mortgage Holdings, Inc.					
5,500 % fällig am 15.08.2028		5.000		4.386	0,14
NCR Corp.					
5,000 % fällig am 01.10.2028		4.000		3.574	0,12
5,250 % fällig am 01.10.2030		2.500		2.177	0,07
5,750 % fällig am 01.09.2027		3.750		3.754	0,12
6,125 % fällig am 01.09.2029		2.000		2.003	0,07
Newell Brands, Inc.					
5,875 % fällig am 01.04.2036		1.525		1.277	0,04
6,375 % fällig am 15.09.2027		1.250		1.200	0,04
Nexstar Media, Inc.					
4,750 % fällig am 01.11.2028		4.000		3.475	0,11
5,625 % fällig am 15.07.2027		4.000		3.732	0,12
NextEra Energy Operating Partners LP					
4,250 % fällig am 15.07.2024		2.000		1.958	0,06
4,250 % fällig am 15.09.2024		262		251	0,01
4,500 % fällig am 15.09.2027		3.000		2.790	0,09
NGL Energy Operating LLC					
7,500 % fällig am 01.02.2026		4.500		4.437	0,14
Noble Finance LLC					
8,000 % fällig am 15.04.2030		4.300		4.376	0,14
Novelis Corp.					
3,250 % fällig am 15.11.2026		3.000		2.719	0,09
3,875 % fällig am 15.08.2031		8.000		6.592	0,22
4,750 % fällig am 30.01.2030		7.000		6.228	0,20
NRG Energy, Inc.					
3,375 % fällig am 15.02.2029		4.250		3.480	0,11
6,625 % fällig am 15.01.2027		1.067		1.060	0,03
NSG Holdings LLC					
7,750 % fällig am 15.12.2025		482		480	0,02
NuStar Logistics LP					
5,750 % fällig am 01.10.2025		2.500		2.440	0,08
6,375 % fällig am 01.10.2030		2.000		1.910	0,06
Olympus Water U.S. Holding Corp.					
3,875 % fällig am 01.10.2028	€	10.000		8.637	0,28
4,250 % fällig am 01.10.2028	$	2.000		1.583	0,05
5,375 % fällig am 01.10.2029 (i)	€	10.000		7.644	0,25
ON Semiconductor Corp.					
3,875 % fällig am 01.09.2028	$	3.500		3.189	0,10
OneMain Finance Corp.					
3,500 % fällig am 15.01.2027		5.000		4.295	0,14
5,375 % fällig am 15.11.2029		5.000		4.256	0,14
6,125 % fällig am 15.03.2024		3.000		2.992	0,10
6,625 % fällig am 15.01.2028		2.000		1.889	0,06
6,875 % fällig am 15.03.2025		5.000		4.955	0,16
7,125 % fällig am 15.03.2026		2.000		1.967	0,06
Organon & Co.					
2,875 % fällig am 30.04.2028	€	7.500		7.122	0,23
4,125 % fällig am 30.04.2028	$	3.000		2.666	0,09
5,125 % fällig am 30.04.2031		6.000		4.958	0,16
Outfront Media Capital LLC					
4,250 % fällig am 15.01.2029		2.500		2.104	0,07
4,625 % fällig am 15.03.2030		2.000		1.669	0,05
5,000 % fällig am 15.08.2027		3.000		2.727	0,09
6,250 % fällig am 15.06.2025		2.000		1.995	0,07
Owens & Minor, Inc.					
6,625 % fällig am 01.04.2030		3.750		3.406	0,11
Owens-Brockway Glass Container, Inc.					
7,250 % fällig am 15.05.2031		2.400		2.433	0,08
Oxford Finance LLC					
6,375 % fällig am 01.02.2027		5.300		4.937	0,16
Pactiv Evergreen Group Issuer LLC					
4,375 % fällig am 15.10.2028		3.000		2.601	0,08
Pactiv Evergreen Group Issuer, Inc.					
4,000 % fällig am 15.10.2027		10.000		8.855	0,29
Park Intermediate Holdings LLC					
4,875 % fällig am 15.05.2029		3.000		2.588	0,08
7,500 % fällig am 01.06.2025		1.000		1.001	0,03

BESCHREIBUNG		PAR (000S)		MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
PDC Energy, Inc.					
5,750 % fällig am 15.05.2026		2.000		1.994	0,07
PennyMac Financial Services, Inc.					
4,250 % fällig am 15.02.2029	$	7.500	$	6.031	0,20
5,750 % fällig am 15.09.2031		2.000		1.633	0,05
Performance Food Group, Inc.					
4,250 % fällig am 01.08.2029		3.000		2.674	0,09
5,500 % fällig am 15.10.2027		5.000		4.825	0,16
6,875 % fällig am 01.05.2025		1.500		1.503	0,05
Permian Resources Operating LLC					
5,375 % fällig am 15.01.2026		2.000		1.907	0,06
5,875 % fällig am 01.07.2029		3.000		2.829	0,09
6,875 % fällig am 01.04.2027		4.000		3.957	0,13
PetSmart, Inc.					
4,750 % fällig am 15.02.2028		12.000		11.103	0,36
7,750 % fällig am 15.02.2029		6.000		5.968	0,19
Post Holdings, Inc.					
4,500 % fällig am 15.09.2031		1.864		1.594	0,05
4,625 % fällig am 15.04.2030		5.000		4.387	0,14
5,500 % fällig am 15.12.2029		5.000		4.620	0,15
5,625 % fällig am 15.01.2028		5.000		4.812	0,16
Prime Security Services Borrower LLC					
3,375 % fällig am 31.08.2027		5.000		4.415	0,14
5,250 % fällig am 15.04.2024		1.600		1.588	0,05
5,750 % fällig am 15.04.2026		4.000		3.930	0,13
6,250 % fällig am 15.01.2028		5.000		4.691	0,15
Radiate Holdco LLC					
4,500 % fällig am 15.09.2026		6.000		4.792	0,16
6,500 % fällig am 15.09.2028		3.000		1.755	0,06
Range Resources Corp.					
4,750 % fällig am 15.02.2030		2.000		1.795	0,06
8,250 % fällig am 15.01.2029		2.000		2.084	0,07
RHP Hotel Properties LP					
4,500 % fällig am 15.02.2029		7.500		6.644	0,22
4,750 % fällig am 15.10.2027		4.000		3.729	0,12
Ritchie Bros Holdings, Inc.					
6,750 % fällig am 15.03.2028		1.400		1.413	0,05
7,750 % fällig am 15.03.2031		2.500		2.597	0,08
RLJ Lodging Trust LP					
4,000 % fällig am 15.09.2029		5.000		4.192	0,14
Rockcliff Energy LLC					
5,500 % fällig am 15.10.2029		5.000		4.617	0,15
Rocket Mortgage LLC					
3,625 % fällig am 01.03.2029		1.750		1.473	0,05
3,875 % fällig am 01.03.2031		3.000		2.435	0,08
4,000 % fällig am 15.10.2033		2.000		1.566	0,05
Rockies Express Pipeline LLC					
3,600 % fällig am 15.05.2025		1.500		1.419	0,05
4,800 % fällig am 15.05.2030		2.000		1.750	0,06
4,950 % fällig am 15.07.2029		4.000		3.664	0,12
Sabre GLBL, Inc.					
7,375 % fällig am 01.09.2025		2.000		1.778	0,06
11,250 % fällig am 15.12.2027		2.280		1.934	0,06
SBA Communications Corp.					
3,125 % fällig am 01.02.2029		7.000		5.940	0,19
3,875 % fällig am 15.02.2027		7.000		6.455	0,21
SCIH Salt Holdings, Inc.					
4,875 % fällig am 01.05.2028		5.000		4.472	0,15
6,625 % fällig am 01.05.2029		3.000		2.517	0,08
SCIL LLC					
9,500 % fällig am 15.07.2028 (a)	€	2.475		2.700	0,09
Scripps Escrow, Inc.					
5,875 % fällig am 15.07.2027	$	5.000		4.054	0,13
Select Medical Corp.					
6,250 % fällig am 15.08.2026		2.000		1.968	0,06
Sensata Technologies, Inc.					
3,750 % fällig am 15.02.2031		6.000		5.138	0,17
Silgan Holdings, Inc.					
2,250 % fällig am 01.06.2028	€	5.750		5.417	0,18
Sirius XM Radio, Inc.					
3,875 % fällig am 01.09.2031	$	2.000		1.548	0,05
4,000 % fällig am 15.07.2028		8.000		6.960	0,23
5,000 % fällig am 01.08.2027		5.000		4.644	0,15
SM Energy Co.					
6,500 % fällig am 15.07.2028		2.000		1.922	0,06
6,625 % fällig am 15.01.2027		2.000		1.944	0,06
Southwestern Energy Co.					
5,375 % fällig am 01.02.2029		5.000		4.713	0,15
5,375 % fällig am 15.03.2030		5.000		4.671	0,15

BESCHREIBUNG		PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
Spectrum Brands, Inc.				
3,875 % fällig am 15.03.2031	$	3.000	$ 2.463	0,08
4,000 % fällig am 01.10.2026	€	2.000	2.101	0,07
5,000 % fällig am 01.10.2029	$	2.000	1.787	0,06
5,750 % fällig am 15.07.2025		480	480	0,02
Spirit AeroSystems, Inc.				
7,500 % fällig am 15.04.2025		6.700	6.629	0,22
9,375 % fällig am 30.11.2029		3.000	3.215	0,11
SRS Distribution, Inc.				
4,625 % fällig am 01.07.2028		7.000	6.259	0,20
6,000 % fällig am 01.12.2029		2.500	2.161	0,07
6,125 % fällig am 01.07.2029		5.000	4.325	0,14
Standard Industries, Inc.				
2,250 % fällig am 21.11.2026	€	20.000	19.433	0,63
3,375 % fällig am 15.01.2031	$	4.000	3.225	0,11
4,375 % fällig am 15.07.2030		2.500	2.167	0,07
4,750 % fällig am 15.01.2028		5.000	4.661	0,15
Station Casinos LLC				
4,500 % fällig am 15.02.2028		3.000	2.696	0,09
Suburban Propane Partners LP				
5,000 % fällig am 01.06.2031		5.000	4.193	0,14
Summer BC Bidco LLC				
5,500 % fällig am 31.10.2026		5.000	4.213	0,14
Syneos Health, Inc.				
3,625 % fällig am 15.01.2029		5.000	4.894	0,16
Tallgrass Energy Partners LP				
5,500 % fällig am 15.01.2028		5.000	4.577	0,15
6,000 % fällig am 31.12.2030		1.000	882	0,03
7,500 % fällig am 01.10.2025		2.000	1.998	0,07
Team Health Holdings, Inc.				
6,375 % fällig am 01.02.2025		7.000	3.723	0,12
TEGNA, Inc.				
4,625 % fällig am 15.03.2028		3.000	2.659	0,09
4,750 % fällig am 15.03.2026		2.000	1.912	0,06
5,000 % fällig am 15.09.2029		5.000	4.318	0,14
Tenet Healthcare Corp.				
4,375 % fällig am 15.01.2030		6.750	6.098	0,20
4,625 % fällig am 15.06.2028		5.000	4.675	0,15
4,875 % fällig am 01.01.2026		2.000	1.950	0,06
5,125 % fällig am 01.11.2027		5.000	4.779	0,16
6,125 % fällig am 01.10.2028		10.000	9.637	0,31
6,125 % fällig am 15.06.2030		5.000	4.935	0,16
TerraForm Power Operating LLC				
4,750 % fällig am 15.01.2030		1.500	1.325	0,04
5,000 % fällig am 31.01.2028		6.500	5.991	0,20
TransDigm, Inc.				
4,625 % fällig am 15.01.2029		8.000	7.126	0,23
5,500 % fällig am 15.11.2027		8.000	7.555	0,25
6,250 % fällig am 15.03.2026		6.000	5.976	0,20
6,750 % fällig am 15.08.2028		2.000	2.010	0,07
Travel + Leisure Co.				
4,625 % fällig am 01.03.2030		5.000	4.236	0,14
6,625 % fällig am 31.07.2026		4.000	3.973	0,13
TriNet Group, Inc.				
3,500 % fällig am 01.03.2029		5.000	4.352	0,14
Triumph Group, Inc.				
9,000 % fällig am 15.03.2028		5.125	5.239	0,17
Twilio, Inc.				
3,625 % fällig am 15.03.2029		4.000	3.407	0,11
3,875 % fällig am 15.03.2031		3.000	2.501	0,08
U.S. Foods, Inc.				
4,625 % fällig am 01.06.2030		2.250	2.019	0,07
4,750 % fällig am 15.02.2029		7.000	6.416	0,21
6,250 % fällig am 15.04.2025		5.000	5.002	0,16

BESCHREIBUNG		PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
Uber Technologies, Inc.				
4,500 % fällig am 15.08.2029	$	7.000	$ 6.456	0,21
United Airlines, Inc.				
4,375 % fällig am 15.04.2026		5.400	5.135	0,17
4,625 % fällig am 15.04.2029		11.900	10.854	0,35
Univision Communications, Inc.				
4,500 % fällig am 01.05.2029		8.000	6.882	0,22
5,125 % fällig am 15.02.2025		4.000	3.920	0,13
6,625 % fällig am 01.06.2027		5.000	4.840	0,16
Venture Global Calcasieu Pass LLC				
3,875 % fällig am 15.08.2029		3.250	2.842	0,09
3,875 % fällig am 01.11.2033		2.500	2.051	0,07
4,125 % fällig am 15.08.2031		3.350	2.886	0,09
6,250 % fällig am 15.01.2030		10.000	9.929	0,32
Venture Global LNG, Inc.				
8,125 % fällig am 01.06.2028		5.300	5.389	0,18
8,375 % fällig am 01.06.2031		9.100	9.187	0,30
Vertiv Group Corp.				
4,125 % fällig am 15.11.2028		9.000	8.117	0,26
ViaSat, Inc.				
5,625 % fällig am 15.09.2025		3.000	2.910	0,10
5,625 % fällig am 15.04.2027		825	771	0,03
6,500 % fällig am 15.07.2028		3.000	2.545	0,08
Viavi Solutions, Inc.				
3,750 % fällig am 01.10.2029		5.000	4.253	0,14
Victoria's Secret & Co.				
4,625 % fällig am 15.07.2029		4.000	2.927	0,10
WESCO Distribution, Inc.				
7,250 % fällig am 15.06.2028		7.500	7.657	0,25
White Cap Buyer LLC				
6,875 % fällig am 15.10.2028		7.375	6.693	0,22
White Cap Parent (8,250 % bar oder 9,000 % PIK)				
8,250 % fällig am 15.03.2026 (b)		3.000	2.877	0,09
WMG Acquisition Corp.				
2,250 % fällig am 15.08.2031	€	3.500	3.041	0,10
3,875 % fällig am 15.07.2030	$	5.000	4.318	0,14
WR Grace Holdings LLC				
4,875 % fällig am 15.06.2027		5.000	4.643	0,15
5,625 % fällig am 15.08.2029		3.000	2.461	0,08
WW International, Inc.				
4,500 % fällig am 15.04.2029		2.000	1.184	0,04
Wyndham Hotels & Resorts, Inc.				
4,375 % fällig am 15.08.2028		5.000	4.571	0,15
Wynn Las Vegas LLC				
5,250 % fällig am 15.05.2027		5.000	4.742	0,15
5,500 % fällig am 01.03.2025		2.000	1.970	0,06
Wynn Resorts Finance LLC				
7,125 % fällig am 15.02.2031		2.500	2.487	0,08
XPO, Inc.				
7,125 % fällig am 01.06.2031		100	101	0,00
Yum! Brands, Inc.				
3,625 % fällig am 15.03.2031		5.000	4.324	0,14
4,625 % fällig am 31.01.2032		1.000	905	0,03
6,875 % fällig am 15.11.2037		2.000	2.161	0,07
Zayo Group Holdings, Inc.				
4,000 % fällig am 01.03.2027		3.000	2.122	0,07
ZF North America Capital, Inc.				
6,875 % fällig am 14.04.2028		1.000	1.014	0,03
7,125 % fällig am 14.04.2030		1.000	1.018	0,03

BESCHREIBUNG		PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
ZoomInfo Technologies LLC				
3,875 % fällig am 01.02.2029		5.000	4.305	0,14
			1.597.237	52,03
KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG				
RegionalCare Hospital Partners Holdings, Inc.				
9,023 % fällig am 16.11.2025	$	4.327	$ 4.018	0,13
Team Health Holdings, Inc.				
7,943 % fällig am 06.02.2024		8.743	7.775	0,25
U.S. Renal Care, Inc.				
10,192 % fällig am 26.06.2026		9.625	4.516	0,15
			16.309	0,53
NON-AGENCY-MBS				
Bear Stearns ALT-A Trust				
3,827 % fällig am 25.03.2036 ^		35	27	0,00
Countrywide Alternative Loan Trust				
5,500 % fällig am 25.11.2035 ^		1.101	664	0,02
Downey Savings & Loan Association Mortgage Loan Trust				
5,467 % fällig am 19.10.2036 ^		347	212	0,01
HarborView Mortgage Loan Trust				
5,417 % fällig am 19.03.2037		76	68	0,00
Residential Funding Mortgage Securities, Inc. Trust				
4,609 % fällig am 25.02.2036 ^		86	74	0,00
Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates Trust				
4,816 % fällig am 25.05.2047 ^		28	4	0,00
4,946 % fällig am 25.05.2046 ^		70	57	0,00
			1.106	0,03
US-SCHATZOBLIGATIONEN				
U.S. Treasury Notes				
3,500 % fällig am 15.09.2025		30.000	29.194	0,95
3,875 % fällig am 30.11.2027		35.700	35.200	1,15
4,125 % fällig am 31.10.2027		50.000	49.748	1,62
4,250 % fällig am 15.10.2025		58.000	57.361	1,87
			171.503	5,59
Summe USA			1.786.155	58,18
KURZFRISTIGE INSTRUMENTE				
U.S. TREASURY BILLS				
5,150 % fällig am 03.08.2023 (c)(d)(j)		78.000	77.657	2,53
Summe kurzfristige Instrumente			77.657	2,53
Summe Übertragbare Wertpapiere			**$ 2.913.163**	**94,90**
		AKTIEN		
INVESTMENTFONDS				
ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN				
PIMCO Funds: Global Investors Series plc - PIMCO Asia High Yield Bond Fund (f)		1.219.084	11.081	0,36
PIMCO Funds: Global Investors Series plc - PIMCO European High Yield Bond Fund (f)		3.637.652	41.195	1,34
PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (f)		7.889.225	78.561	2,56
Summe Investmentfonds			**$ 130.837**	**4,26**

PENSIONSGESCHÄFTE

Kontrahent	Kredit-zins	Abrechnungs-datum	Fälligkeits-datum	Kapital-betrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensions-geschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensions-geschäft[1]	% des Nettovermögens
FICC	2,400 %	30.06.2023	03.07.2023	$ 3.895	U.S. Treasury Notes 4,625 % fällig am 30.06.2025	$ (3.973)	$ 3.895	$ 3.895	0,13
Summe Pensionsgeschäfte						**$ (3.973)**	**$ 3.895**	**$ 3.895**	**0,13**

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

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

FUTURES

Beschreibung	Art	Ablauf-monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Euro-Bobl September Futures	Short	09.2023	1.726	$ 2.312	0,08
U.S. Treasury 5-Year Note September Futures	Long	09.2023	816	(1.112)	(0,04)
				$ 1.200	0,04
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate				**$ 1.200**	**0,04**

ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)

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

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMMISSIONEN - SCHUTZVERKAUF[1]

Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag[2]	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Newell Brands, Inc.	1,000 %	20.06.2028	$ 2.400	$ 20	0,00

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES - SCHUTZVERKAUF[1]

Index/Tranchen	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag[2]	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
CDX.HY-40 5-Year Index	5,000 %	20.06.2028	$ 22.200	$ 720	0,02
Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate				**$ 740**	**0,02**

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

(2) Der maximal mögliche Betrag, den der Fonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

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

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

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMMISSIONEN - SCHUTZVERKAUF[1]

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag[2]	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Markt-wert	% des Nettovermögens
JLN	Cellnex Telecom S.A.	5,000 %	20.06.2028	€ 200	$ 30	$ 2	$ 32	0,00

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

(2) Der maximal mögliche Betrag, den der Fonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2023	€ 4.885	$ 5.292	$ 2	$ (39)	$ (37)	0,00
BPS	07.2023	767.233	824.859	2	(12.196)	(12.194)	(0,40)
	07.2023	$ 3.569	€ 3.267	0	(5)	(5)	0,00
CBK	07.2023	€ 8.759	$ 9.468	8	(96)	(88)	0,00
	07.2023	$ 5.166	€ 4.770	38	0	38	0,00
	08.2023	CAD 861	$ 646	0	(5)	(5)	0,00
JPM	07.2023	£ 145	184	0	(1)	(1)	0,00
	07.2023	$ 835.611	€ 765.282	0	(688)	(688)	(0,02)
	08.2023	CAD 1.416	$ 1.059	0	(12)	(12)	0,00
	08.2023	€ 765.282	836.780	715	0	715	0,02
	08.2023	$ 184	£ 145	1	0	1	0,00
MBC	07.2023	€ 7.738	$ 8.414	24	(52)	(28)	0,00
	07.2023	£ 47.813	59.186	0	(1.601)	(1.601)	(0,05)
	07.2023	$ 11.435	€ 10.595	124	0	124	0,00
MYI	07.2023	€ 58	$ 63	0	0	0	0,00
	07.2023	£ 396	498	0	(6)	(6)	0,00

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
	07.2023	$ 2.624	€ 2.451	$ 50	$ 0	$ 50	0,00
	07.2023	5.438	£ 4.309	41	0	41	0,00
TOR	07.2023	60.934	47.953	31	0	31	0,00
	08.2023	£ 47.953	$ 60.948	0	(30)	(30)	0,00
				$ 1.036	$ (14.731)	$ (13.695)	(0,45)

ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklassen Institutional CHF (Hedged) thesaurierend und Institutional CHF (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BPS	07.2023	CHF 8.275	$ 9.253	$ 3	$ 0	$ 3	0,00
	07.2023	$ 12.169	CHF 11.009	136	0	136	0,01
	08.2023	9.253	8.252	0	(3)	(3)	0,00
CLY	07.2023	CHF 4.374	$ 4.869	0	(20)	(20)	0,00
	08.2023	$ 4.869	CHF 4.361	20	0	20	0,00
MBC	07.2023	CHF 358	$ 399	0	(2)	(2)	0,00
	07.2023	$ 116	CHF 105	2	0	2	0,00
MYI	07.2023	CHF 93	$ 103	0	(1)	(1)	0,00
	07.2023	$ 33	CHF 30	0	0	0	0,00
SCX	07.2023	8.935	8.028	39	0	39	0,00
UAG	07.2023	CHF 8.544	$ 9.531	0	(19)	(19)	0,00
	07.2023	$ 8.052	CHF 7.235	35	0	35	0,00
	08.2023	9.531	8.520	19	0	19	0,00
				$ 254	$ (45)	$ 209	0,01

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklassen Institutional EUR (Hedged) thesaurierend, Institutional EUR (Hedged) ausschüttend, Investor EUR (Hedged) thesaurierend, E Class EUR (Hedged) thesaurierend und E Class EUR (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2023	€ 437	$ 473	$ 0	$ (4)	$ (4)	0,00
	07.2023	$ 392.875	€ 365.549	5.943	(2)	5.941	0,19
BPS	07.2023	€ 377.818	$ 414.037	1.840	(3)	1.837	0,06
	07.2023	$ 393.164	€ 365.704	5.821	(2)	5.819	0,19
	08.2023	397.293	362.084	0	(1.719)	(1.719)	(0,05)
CBK	07.2023	€ 364.241	$ 395.945	2	(1.444)	(1.442)	(0,05)
	07.2023	$ 293	€ 270	2	0	2	0,00
	08.2023	389.917	358.138	1.347	0	1.347	0,04
JPM	07.2023	€ 362.629	$ 395.955	326	0	326	0,01
	07.2023	$ 9.812	€ 9.177	200	0	200	0,01
	08.2023	396.508	362.629	0	(338)	(338)	(0,01)
MBC	07.2023	€ 1.676	$ 1.796	1	(33)	(32)	0,00
	07.2023	$ 2.211	€ 2.060	37	0	37	0,00
SOG	07.2023	391.584	364.014	5.555	0	5.555	0,18
				$ 21.074	$ (3.545)	$ 17.529	0,57

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklassen Institutional GBP (Hedged) thesaurierend, Institutional GBP (Hedged) ausschüttend und E Class GBP (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2023	£ 895	$ 1.127	$ 0	$ (10)	$ (10)	0,00
	07.2023	$ 671	£ 528	0	0	0	0,00
BPS	07.2023	£ 49	$ 61	0	(2)	(2)	0,00
	07.2023	$ 135.368	£ 109.441	3.771	0	3.771	0,12
BRC	07.2023	£ 787	$ 980	0	(21)	(21)	0,00
	07.2023	$ 3.592	£ 2.822	0	(4)	(4)	0,00
CBK	07.2023	£ 7.257	$ 9.202	4	(29)	(25)	0,00
	07.2023	$ 594	£ 467	0	(1)	(1)	0,00
JPM	07.2023	£ 107.650	$ 136.113	0	(748)	(748)	(0,02)
	08.2023	$ 136.142	£ 107.650	747	0	747	0,02
MBC	07.2023	135.292	109.288	3.651	0	3.651	0,12
MYI	07.2023	£ 363	$ 450	0	(12)	(12)	0,00
	07.2023	$ 135.000	£ 108.620	3.095	0	3.095	0,10
SCX	07.2023	£ 244	$ 304	0	(7)	(7)	0,00
TOR	07.2023	108.645	138.055	0	(71)	(71)	0,00
	08.2023	$ 138.085	£ 108.645	68	0	68	0,00
				$ 11.336	$ (905)	$ 10.431	0,34

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklasse Class E SGD (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung		Zu erhaltende Währung		Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BRC	07.2023	$	1.662	SGD	2.249	$ 0	$ 0	$ 0	0,00
GLM	07.2023	SGD	29	$	22	0	0	0	0,00
	07.2023	$	119	SGD	160	0	0	0	0,00
MBC	07.2023	SGD	16	$	12	0	0	0	0,00
	07.2023	$	1.519	SGD	2.052	0	(3)	(3)	0,00
	08.2023		13		18	0	0	0	0,00
MYI	07.2023	SGD	2.426	$	1.795	3	0	3	0,00
	07.2023	$	1	SGD	2	0	0	0	0,00
	08.2023		1.758		2.373	0	(3)	(3)	0,00
SCX	07.2023		201		272	0	0	0	0,00
UAG	07.2023		2.031		2.748	0	(1)	(1)	0,00
						$ 3	$ (7)	$ (4)	0,00

Summe Freiverkehrsfinanzderivate	**$ 14.502**	**0,47**
Summe Anlagen	**$ 3.064.337**	**99,82**
Sonstige Aktiva und Passiva	**$ 5.499**	**0,18**
Nettovermögen	**$ 3.069.836**	**100,00**

ERLÄUTERUNGEN ZUR AUFSTELLUNG DES WERTPAPIERBESTANDS (Angaben in Tausend*):

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

^ **Das Wertpapier ist in Verzug.**

(a) **Wertpapier per Emissionstermin.**

(b) **Wertpapier mit Sachwertausschüttung.**

(c) **Nullkuponwertpapier.**

(d) **Der Kupon stellt eine Rendite bis zur Endfälligkeit dar.**

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

(f) **Mit dem Fonds verbunden.**

(g) **Bedingt wandelbares Wertpapier.**

(h) **Eingeschränkte Wertpapiere (31. Dezember 2022: 0,00 %):**

Emittentenbeschreibung	Kupon	Fälligkeits-datum	Kauf-datum	Kosten	Markt-wert	% des Nettovermögens
Diamond Foreign Asset Co. (9,000 % bar oder 9,000 % PIK)	9,000 %	22.04.2027	12.05.2021	$ 66	$ 64	0,00

(i) **Wertpapiere mit einem gesamten beizulegenden Zeitwert von 11.629 USD (31. Dezember 2022: 10.952 USD) wurden zum 30. Juni 2023 gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen als Sicherheit für Pensionsgeschäfte verpfändet.**

(j) **Wertpapier mit einem gesamten beizulegenden Zeitwert von 49 USD (31. Dezember 2022: null USD) und Barmittel in Höhe von 2.600 USD (31. Dezember 2022: 8.590 USD) wurden zum 30. Juni 2023 gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. als Sicherheit für Finanzderivate verpfändet.**

Barmittel in Höhe von 12.259 USD (31. Dezember 2022: 20.021 USD) wurden zum 30. Juni 2023 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Barmittel in Höhe von null USD (31. Dezember 2022: 205 USD) wurden zum 30. Juni 2023 gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte als Sicherheit geliefert.

Beizulegender Zeitwert[1]

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 30. Juni 2023 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie[2]	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	$ 0	$ 2.912.555	$ 608	$ 2.913.163
Investmentfonds	130.837	0	0	130.837
Pensionsgeschäfte	0	3.895	0	3.895
Finanzderivate[3]	2.312	14.130	0	16.442
Summen	**$ 133.149**	**$ 2.930.580**	**$ 608**	**$ 3.064.337**

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

Kategorie[2]	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	$ 0	$ 2.850.743	$ 43	$ 2.850.786
Investmentfonds	201.583	0	0	201.583
Pensionsgeschäfte	0	11.412	0	11.412
Finanzderivate[3]	933	15.128	0	16.061
Summen	**$ 202.516**	**$ 2.877.283**	**$ 43**	**$ 3.079.842**

(1) Weitere Informationen finden Sie in den Erläuterungen in Erläuterung 3.

(2) Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung des Wertpapierbestands.

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

Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2023:

Kontrahent	Kredit-zins	Abrechnungs-datum	Fälligkeits-datum	Kredit-betrag	Verbindlichkeiten aus umgekehrten Pensions-geschäften	% des Nettovermögens
BRC	2,000 %	10.05.2023	TBD(1)	€ (1.749)	$ (1.913)	(0,06)
JML	2,500	06.06.2023	TBD(1)	(2.528)	(2.762)	(0,09)
	2,500	08.06.2023	TBD(1)	(2.124)	(2.321)	(0,08)
	2,500	12.06.2023	TBD(1)	(1.273)	(1.390)	(0,05)
MYI	2,200	31.05.2023	TBD(1)	(2.025)	(2.213)	(0,07)
	2,500	17.05.2023	TBD(1)	(1.266)	(1.386)	(0,04)
Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte					**$ (11.985)**	**(0,39)**

(1) Umgekehrtes Pensionsgeschäft mit offener Laufzeit.

Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC-Finanzderivate und -Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2023 und 31. Dezember 2022:

	Zum 30. Jun. 2023			Zum 31. Dez. 2022		
Kontrahent	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-engagement(1)	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-engagement(1)
BOA	$ 5.890	$ (4.505)	$ 1.385	$ 1.580	$ (1.340)	$ 240
BPS	(2.357)	2.600	243	33	0	33
BRC	(25)	0	(25)	9	0	9
CBK	(174)	0	(174)	11.688	(11.530)	158
GLM	k. A.	k. A.	k. A.	3	(10)	(7)
JLN	32	0	32	k. A.	k. A.	k. A
JPM	202	(270)	(68)	(416)	50	(366)
MBC	2.148	(1.630)	518	8.000	(7.460)	540
MYI	3.167	(2.240)	927	(51)	0	(51)
SCX	32	0	32	(9.114)	8.540	(574)
SOG	5.555	(4.100)	1.455	k. A.	k. A.	k. A.
TOR	(2)	0	(2)	100	(180)	(80)
UAG	34	49	83	5	0	5

(1) Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären.

Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung des Wertpapierbestands zum 30. Juni 2023:

	30. Jun. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	50,99	49,58
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	43,90	42,29
Sonstige übertragbare Wertpapiere	0,01	0,01
Investmentfonds	4,26	6,50
Pensionsgeschäfte	0,13	0,37
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	0,04	0,03
Zentral abgerechnete Finanzderivate	0,02	0,10
Freiverkehrsfinanzderivate	0,47	0,38
Umgekehrte Pensionsgeschäfte	(0,39)	(0,34)

Das Anlageportfolio des Fonds konzentriert sich zum 30. Juni 2023 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	30. Jun. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
Belgien	0,24	0,22
Bermudas	0,66	0,40
Kanada	1,62	1,55
Cayman-Inseln	0,62	0,78
Tschechische Republik	0,71	k. A.
Dänemark	k. A.	0,09
Frankreich	3,11	1,95
Deutschland	3,40	2,67
Irland	0,24	0,22
Italien	4,20	3,75
Jersey, Kanalinseln	0,12	0,20
Liberia	1,06	0,67
Luxemburg	3,27	2,47
Multinational	2,03	1,67
Niederlande	4,64	5,00
Norwegen	0,33	0,34
Panama	0,66	0,53
Spanien	2,21	1,70
Schweden	0,89	0,91

Anlagen zum Marktwert	30. Jun. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
Schweiz	k. A.	0,11
Großbritannien	4,18	3,84
USA	58,18	59,77
Kurzfristige Instrumente	2,53	3,04
Investmentfonds	4,26	6,50
Pensionsgeschäfte	0,13	0,37
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	0,04	0,03
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	0,00	k. A.
Credit Default Swaps auf Kreditindizes— Schutzverkauf	0,02	0,10
Freiverkehrsfinanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	0,00	k. A.
Devisenterminkontrakte	(0,45)	(0,64)
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	0,92	1,02
Sonstige Aktiva und Passiva	0,18	0,74
Nettovermögen	100,00	100,00

BESCHREIBUNG		PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE				
AUSTRALIEN				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Boral Finance Pty. Ltd.				
3,750 % fällig am 01.05.2028	$	415	$ 371	0,00
CIMIC Finance Ltd.				
1,500 % fällig am 28.05.2029	€	4.300	3.688	0,04
GAIF Bond Issuer Pty. Ltd.				
1,900 % fällig am 14.12.2028	AUD	23.500	12.697	0,12
GTA Finance Co. Pty. Ltd.				
2,200 % fällig am 26.08.2027		7.200	4.123	0,04
Lendlease Finance Ltd.				
3,400 % fällig am 27.10.2027		9.900	5.786	0,06
Macquarie University				
3,500 % fällig am 07.09.2028		250	153	0,00
Network Finance Co. Pty. Ltd.				
6,061 % fällig am 19.06.2030		700	467	0,00
Optus Finance Pty. Ltd.				
1,000 % fällig am 20.06.2029	€	6.800	6.098	0,06
Pacific National Finance Pty. Ltd.				
4,750 % fällig am 22.03.2028	$	15.900	14.459	0,14
Qantas Airways Ltd.				
3,150 % fällig am 27.09.2028	AUD	500	288	0,00
Santos Finance Ltd.				
4,125 % fällig am 14.09.2027	$	7.800	7.194	0,07
5,250 % fällig am 13.03.2029		21.600	20.330	0,19
Woodside Finance Ltd.				
3,700 % fällig am 15.03.2028		600	553	0,01
4,500 % fällig am 04.03.2029		26.390	24.904	0,24
			101.111	0,97
STAATSEMISSIONEN				
Australia Government International Bond				
1,000 % fällig am 21.11.2031	AUD	51.800	27.144	0,26
1,250 % fällig am 21.05.2032		24.000	12.698	0,12
4,500 % fällig am 21.04.2033		59.700	41.258	0,39
			81.100	0,77
Summe Australien			182.211	1,74
ÖSTERREICH				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Erste Group Bank AG				
4,250 % fällig am 15.10.2027 (g)(i)	€	17.800	14.812	0,14
5,125 % fällig am 15.10.2025 (g)(i)		5.600	5.425	0,05
Summe Österreich			20.237	0,19
BELGIEN				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
KBC Group NV				
4,250 % fällig am 24.10.2025 (g)(i)		5.000	4.717	0,04
Sofina S.A.				
1,000 % fällig am 23.09.2028		9.300	8.126	0,08
Summe Belgien			12.843	0,12
BERMUDAS				
FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE				
MAPS Ltd.				
4,212 % fällig am 15.05.2043	$	5.281	4.718	0,05
START Ltd.				
4,089 % fällig am 15.03.2044		2.870	2.531	0,02
			7.249	0,07
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Aircastle Ltd.				
2,850 % fällig am 26.01.2028		6.400	5.450	0,05
4,250 % fällig am 15.06.2026		3.050	2.875	0,03
Arch Capital Group Ltd.				
3,635 % fällig am 30.06.2050		2.760	2.026	0,02
Bacardi Ltd.				
2,750 % fällig am 15.07.2026		1.950	1.796	0,02
4,450 % fällig am 15.05.2025		10.410	10.136	0,10
4,700 % fällig am 15.05.2028	$	26.330	$ 25.482	0,24
Viking Cruises Ltd.				
13,000 % fällig am 15.05.2025		4.300	4.518	0,04
			52.283	0,50
Summe Bermudas			59.532	0,57
BRASILIEN				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Banco BTG Pactual S.A.				
4,500 % fällig am 10.01.2025		14.200	13.729	0,13
CSN Resources S.A.				
5,875 % fällig am 08.04.2032		8.100	6.532	0,06
Summe Brasilien			20.261	0,19
KANADA				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Air Canada Pass-Through Trust				
3,300 % fällig am 15.07.2031		2.412	2.139	0,02
3,600 % fällig am 15.09.2028		5.561	5.170	0,05
3,750 % fällig am 15.06.2029		2.650	2.415	0,02
4,125 % fällig am 15.11.2026		3.277	3.065	0,03
5,250 % fällig am 01.10.2030		3.429	3.328	0,03
Bank of Montreal				
4,689 % fällig am 28.07.2029		5.000	4.972	0,05
Bank of Nova Scotia				
4,900 % fällig am 04.06.2025 (g)(i)		18.100	17.133	0,16
Brookfield Finance, Inc.				
3,500 % fällig am 30.03.2051		19.100	12.677	0,12
3,900 % fällig am 25.01.2028		3.000	2.781	0,03
4,700 % fällig am 20.09.2047		2.300	1.927	0,02
4,850 % fällig am 29.03.2029		8.834	8.483	0,08
Canadian Pacific Railway Co.				
3,100 % fällig am 02.12.2051		3.000	2.132	0,02
CI Financial Corp.				
4,100 % fällig am 15.06.2051		11.350	6.915	0,07
Enbridge, Inc.				
4,250 % fällig am 01.12.2026		10.504	10.137	0,10
5,700 % fällig am 08.03.2033		2.400	2.434	0,02
Fairfax Financial Holdings Ltd.				
2,750 % fällig am 29.03.2028	€	29.600	29.094	0,28
4,850 % fällig am 17.04.2028	$	100	96	0,00
Honda Canada Finance, Inc.				
1,646 % fällig am 25.02.2028	CAD	7.200	4.698	0,04
Toronto-Dominion Bank				
4,680 % fällig am 08.01.2029		14.600	10.826	0,10
			130.422	1,24
STAATSEMISSIONEN				
Canada Government International Bond				
2,750 % fällig am 01.12.2048		500	353	0,00
Province of Ontario				
2,050 % fällig am 02.06.2030		11.700	7.829	0,08
2,600 % fällig am 02.06.2025		151.500	110.098	1,05
Province of Quebec				
1,900 % fällig am 01.09.2030		4.500	2.969	0,03
			121.249	1,16
Summe Kanada			251.671	2,40
CAYMAN INSELN				
FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE				
Blackbird Capital Aircraft Lease Securitization Ltd.				
4,213 % fällig am 16.12.2041	$	5.433	5.002	0,05
KDAC Aviation Finance Ltd.				
4,212 % fällig am 15.12.2042		3.991	3.319	0,03
Sapphire Aviation Finance Ltd.				
4,250 % fällig am 15.03.2040		7.500	6.250	0,06
Thunderbolt Aircraft Lease Ltd.				
4,212 % fällig am 17.05.2032		2.708	2.454	0,02
			17.025	0,16
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Alibaba Group Holding Ltd.				
2,125 % fällig am 09.02.2031		4.100	3.341	0,03
4,400 % fällig am 06.12.2057	$	8.200	$ 6.435	0,06
Avolon Holdings Funding Ltd.				
2,528 % fällig am 18.11.2027		14.256	12.035	0,12
2,875 % fällig am 15.02.2025		8.300	7.723	0,07
4,250 % fällig am 15.04.2026		3.600	3.356	0,03
4,375 % fällig am 01.05.2026		2.310	2.160	0,02
5,500 % fällig am 15.01.2026		18.600	18.032	0,17
China Modern Dairy Holdings Ltd.				
2,125 % fällig am 14.07.2026		9.400	8.054	0,08
Gaci First Investment Co.				
4,750 % fällig am 14.02.2030		2.600	2.562	0,03
4,875 % fällig am 14.02.2035		1.900	1.824	0,02
5,125 % fällig am 14.02.2053		13.000	11.716	0,11
Goodman HK Finance				
4,375 % fällig am 19.06.2024		3.500	3.437	0,03
Melco Resorts Finance Ltd.				
4,875 % fällig am 06.06.2025		16.760	15.984	0,15
5,250 % fällig am 26.04.2026		3.650	3.382	0,03
5,375 % fällig am 04.12.2029		3.027	2.515	0,02
5,625 % fällig am 17.07.2027		8.655	7.849	0,08
5,750 % fällig am 21.07.2028		2.100	1.859	0,02
MGM China Holdings Ltd.				
5,250 % fällig am 18.06.2025		8.300	7.966	0,08
5,375 % fällig am 15.05.2024		1.255	1.237	0,01
5,875 % fällig am 15.05.2026		6.746	6.434	0,06
Sands China Ltd.				
2,800 % fällig am 08.03.2027		1.000	869	0,01
3,350 % fällig am 08.03.2029		1.500	1.251	0,01
4,300 % fällig am 08.01.2026		3.900	3.670	0,04
5,900 % fällig am 08.08.2028		14.348	13.690	0,13
Sunny Optical Technology Group Co. Ltd.				
5,950 % fällig am 17.07.2026		10.700	10.684	0,10
Tencent Holdings Ltd.				
2,390 % fällig am 03.06.2030		11.900	9.893	0,10
3,240 % fällig am 03.06.2050		5.200	3.416	0,03
3,290 % fällig am 03.06.2060		700	435	0,00
3,975 % fällig am 11.04.2029		32.750	30.464	0,29
Tencent Music Entertainment Group				
2,000 % fällig am 03.09.2030		2.800	2.212	0,02
Tingyi Cayman Islands Holding Corp.				
1,625 % fällig am 24.09.2025		11.500	10.466	0,10
Wynn Macau Ltd.				
4,875 % fällig am 01.10.2024		4.635	4.524	0,04
5,500 % fällig am 15.01.2026		8.757	8.144	0,08
5,500 % fällig am 01.10.2027		2.000	1.782	0,02
Xiaomi Best Time International Ltd.				
2,875 % fällig am 14.07.2031		1.900	1.437	0,01
Zhongsheng Group Holdings Ltd.				
3,000 % fällig am 13.01.2026		7.100	6.476	0,06
			237.314	2,26
Summe Cayman Inseln			254.339	2,42
CHILE				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Celeo Redes Operacion Chile S.A.				
5,200 % fällig am 22.06.2047		1.515	1.369	0,01
Empresa Electrica Cochrane SpA				
5,500 % fällig am 14.05.2027		961	889	0,01
Summe Chile			2.258	0,02
CHINA				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
State Grid Overseas Investment BVI Ltd.				
0,797 % fällig am 05.08.2026	€	12.223	12.100	0,11
2,125 % fällig am 02.05.2030		5.400	5.127	0,05
Summe China			17.227	0,16
KOLUMBIEN				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Ecopetrol S.A.				
8,875 % fällig am 13.01.2033	$	8.000	7.929	0,08
ZYPERN				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Atrium Finance PLC				
2,625 % fällig am 05.09.2027	€	12.100	9.625	0,09

BESCHREIBUNG		PAR (000S)		MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
TSCHECHISCHE REPUBLIK					
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL					
EP Infrastructure A/S					
1,659 % fällig am 26.04.2024	€	5.500	$	5.721	0,05
DÄNEMARK					
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL					
GN Store Nord A/S					
0,875 % fällig am 25.11.2024		13.800		14.046	0,13
Jyske Realkredit A/S					
1,500 % fällig am 01.10.2053	DKK	8.757		966	0,01
Nordea Kredit Realkreditaktieselskab					
1,000 % fällig am 01.10.2050		4.082		431	0,00
Nykredit Realkredit A/S					
1,000 % fällig am 01.10.2050		100.443		10.570	0,10
1,000 % fällig am 01.10.2053		9.336		955	0,01
1,500 % fällig am 01.10.2053		6.906		762	0,01
Realkredit Danmark A/S					
1,000 % fällig am 01.10.2050		33.917		3.573	0,04
1,000 % fällig am 01.10.2053		3.671		356	0,00
1,500 % fällig am 01.10.2053		6.916		763	0,01
Summe Dänemark				32.422	0,31
FINNLAND					
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL					
Balder Finland Oyj					
1,000 % fällig am 20.01.2029	€	14.100		9.820	0,09
Nokia Oyj					
4,375 % fällig am 12.06.2027	$	2.800		2.640	0,03
Nordea Bank Abp					
3,750 % fällig am 01.03.2029 (g)(i)		4.000		2.970	0,03
SATO Oyj					
1,375 % fällig am 24.02.2028	€	6.671		5.506	0,05
Teollisuuden Voima Oyj					
4,750 % fällig am 01.06.2030		1.200		1.310	0,01
Summe Finnland				22.246	0,21
FRANKREICH					
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL					
Altarea S.C.A.					
1,750 % fällig am 16.01.2030		11.200		8.540	0,08
1,875 % fällig am 17.01.2028		5.900		5.206	0,05
BNP Paribas S.A.					
1,904 % fällig am 30.09.2028	$	4.700		4.008	0,04
2,219 % fällig am 09.06.2026		21.000		19.433	0,18
3,500 % fällig am 16.11.2027		20.000		18.399	0,18
5,198 % fällig am 10.01.2030		15.000		14.512	0,14
Bureau Veritas S.A.					
1,250 % fällig am 07.09.2023	€	300		326	0,00
1,875 % fällig am 06.01.2025		15.400		16.227	0,15
Credit Agricole S.A.					
5,301 % fällig am 12.07.2028	$	900		898	0,01
Electricite de France S.A.					
4,625 % fällig am 25.01.2043	€	2.100		2.200	0,02
5,625 % fällig am 25.01.2053	£	5.300		5.775	0,05
6,250 % fällig am 23.05.2033	$	12.000		12.207	0,12
6,900 % fällig am 23.05.2053		4.100		4.253	0,04
9,125 % fällig am 15.03.2033 (g)		3.400		3.495	0,03
Holding d'Infrastructures de Transport SASU					
1,475 % fällig am 18.01.2031	€	9.200		8.202	0,08
1,625 % fällig am 18.09.2029		3.700		3.451	0,03
Holding d'Infrastructures des Metiers de l'Environnement					
0,625 % fällig am 16.09.2028		3.200		2.858	0,03
Indigo Group S.A.S.					
1,625 % fällig am 19.04.2028		9.800		9.427	0,09
New Immo Holding S.A.					
2,750 % fällig am 26.11.2026		2.800		2.739	0,03
Peugeot Invest					
1,875 % fällig am 30.10.2026		18.500		18.395	0,17
SEB S.A.					
1,375 % fällig am 16.06.2025		6.900		7.121	0,07
Societe Generale S.A.					
1,488 % fällig am 14.12.2026	$	13.400		11.800	0,11
2,889 % fällig am 09.06.2032	$	25.000	$	19.609	0,19
6,691 % fällig am 10.01.2034		26.900		27.405	0,26
TDF Infrastructure SASU					
1,750 % fällig am 01.12.2029	€	9.100		8.009	0,08
2,500 % fällig am 07.04.2026		7.300		7.484	0,07
Ubisoft Entertainment S.A.					
0,878 % fällig am 24.11.2027		18.600		15.598	0,15
				257.577	2,45
KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG					
Altice France S.A.					
8,677 % fällig am 15.08.2028		4.216		4.023	0,04
STAATSEMISSIONEN					
Caisse d'Amortissement de la Dette Sociale					
3,000 % fällig am 25.11.2031		4.400		4.767	0,05
Summe Frankreich				266.367	2,54
DEUTSCHLAND					
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL					
Bayer AG					
0,625 % fällig am 12.07.2031		1.000		839	0,01
Deutsche Bank AG					
1,750 % fällig am 19.11.2030		40.300		34.794	0,33
2,311 % fällig am 16.11.2027	$	2.800		2.408	0,02
2,625 % fällig am 16.12.2024	£	15.000		17.750	0,17
3,547 % fällig am 18.09.2031	$	12.643		10.507	0,10
3,961 % fällig am 26.11.2025		600		572	0,01
Fraport AG Frankfurt Airport Services Worldwide					
1,625 % fällig am 09.07.2024	€	9.200		9.776	0,10
1,875 % fällig am 31.03.2028		8.700		8.396	0,08
2,125 % fällig am 09.07.2027		14.700		14.730	0,14
Hamburg Commercial Bank AG					
0,500 % fällig am 22.09.2026		100		91	0,00
IHO Verwaltungs GmbH (3,750 % bar oder 4,500 % PIK)					
3,750 % fällig am 15.09.2026 (c)		19.800		20.209	0,19
Robert Bosch GmbH					
3,625 % fällig am 02.06.2030		2.000		2.164	0,02
4,000 % fällig am 02.06.2035		2.200		2.438	0,02
4,375 % fällig am 02.06.2043		300		336	0,00
Sixt SE					
1,750 % fällig am 09.12.2024		11.070		11.656	0,11
Volkswagen Bank GmbH					
4,375 % fällig am 03.05.2028		400		435	0,01
4,625 % fällig am 03.05.2031		5.300		5.809	0,06
Volkswagen Leasing GmbH					
1,500 % fällig am 19.06.2026		7.500		7.544	0,07
Vonovia SE					
0,250 % fällig am 01.09.2028		8.900		7.560	0,07
				158.014	1,51
STAATSEMISSIONEN					
Bundesrepublik Deutschland					
1,300 % fällig am 15.10.2027		5.100		5.266	0,05
Summe Deutschland				163.280	1,56
GUERNSEY, KANALINSELN					
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL					
Amdocs Ltd.					
2,538 % fällig am 15.06.2030	$	5.975		4.993	0,05
Globalworth Real Estate Investments Ltd.					
2,950 % fällig am 29.07.2026	€	16.900		13.899	0,13
3,000 % fällig am 29.03.2025		1.100		993	0,01
Sirius Real Estate Ltd.					
1,125 % fällig am 22.06.2026		8.500		7.668	0,07
1,750 % fällig am 24.11.2028		10.100		7.871	0,08
Summe Guernsey, Kanalinseln				35.424	0,34
HONGKONG					
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL					
AIA Group Ltd.					
4,950 % fällig am 04.04.2033	$	300		300	0,00
Lenovo Group Ltd.					
3,421 % fällig am 02.11.2030		6.400		5.398	0,05
				5.698	0,05
STAATSEMISSIONEN					
Airport Authority Hong Kong					
2,400 % fällig am 08.03.2028 (g)	$	2.350	$	2.071	0,02
3,450 % fällig am 21.02.2029		5.500		5.103	0,05
				7.174	0,07
Summe Hongkong				12.872	0,12
INDIEN					
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL					
Adani Transmission Step-One Ltd.					
4,250 % fällig am 21.05.2036		17.033		12.896	0,12
Bharti Airtel Ltd.					
4,375 % fällig am 10.06.2025		5.000		4.862	0,05
ReNew Power Pvt Ltd.					
5,875 % fällig am 05.03.2027		4.978		4.667	0,04
Summe Indien				22.425	0,21
INDONESIEN					
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL					
Bank Rakyat Indonesia Persero Tbk PT					
4,625 % fällig am 20.07.2023		2.900		2.899	0,03
Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia					
2,800 % fällig am 23.06.2030		6.600		5.827	0,05
4,450 % fällig am 20.02.2029		800		788	0,01
Perusahaan Perseroan Persero PT Perusahaan Listrik Negara					
4,000 % fällig am 30.06.2050		7.800		5.583	0,05
4,875 % fällig am 17.07.2049		700		572	0,01
6,150 % fällig am 21.05.2048		2.300		2.226	0,02
Summe Indonesien				17.895	0,17
IRLAND					
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL					
AerCap Ireland Capital DAC					
1,150 % fällig am 29.10.2023		1.310		1.289	0,01
1,650 % fällig am 29.10.2024		2.900		2.727	0,03
2,450 % fällig am 29.10.2026		3.200		2.861	0,03
2,875 % fällig am 14.08.2024		3.300		3.173	0,03
3,150 % fällig am 15.02.2024		6.200		6.084	0,06
4,450 % fällig am 01.10.2025		400		385	0,00
4,450 % fällig am 03.04.2026		5.475		5.233	0,05
5,772 % fällig am 29.09.2023		4.900		4.893	0,05
AIB Group PLC					
4,263 % fällig am 10.04.2025		11.300		11.044	0,10
Bank of Ireland Group PLC					
6,000 % fällig am 01.09.2025 (g)(i)	€	5.109		5.288	0,05
6,253 % fällig am 16.09.2026	$	8.700		8.646	0,08
Perrigo Finance Unlimited Co.					
4,900 % fällig am 15.12.2044		4.800		3.719	0,04
SMBC Aviation Capital Finance DAC					
3,550 % fällig am 15.04.2024		3.800		3.721	0,04
4,125 % fällig am 15.07.2023		6.600		6.595	0,06
STERIS Irish FinCo UnLtd Co.					
2,700 % fällig am 15.03.2031		2.900		2.419	0,02
Zurich Finance Ireland Designated Activity Co.					
5,125 % fällig am 23.11.2052	£	3.700		4.075	0,04
Summe Irland				72.152	0,69
ITALIEN					
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL					
Aeroporti di Roma SpA					
1,750 % fällig am 30.07.2031	€	1.700		1.507	0,01
AMCO - Asset Management Co. SpA					
1,500 % fällig am 17.07.2023		13.930		15.187	0,15
4,625 % fällig am 06.02.2027		4.800		5.206	0,05
Banca Monte dei Paschi di Siena SpA					
1,875 % fällig am 09.01.2026		27.200		26.428	0,25
2,625 % fällig am 28.04.2025		16.100		16.490	0,16
Intesa Sanpaolo SpA					
4,000 % fällig am 23.09.2029	$	10.600		9.218	0,09
5,017 % fällig am 26.06.2024		5.900		5.717	0,05
5,710 % fällig am 15.01.2026		14.819		14.117	0,14
Mundys SpA					
1,625 % fällig am 03.02.2025	€	4.100		4.276	0,04
1,875 % fällig am 13.07.2027		15.770		15.260	0,15

BESCHREIBUNG		PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
1,875 % fällig am 12.02.2028	€	1.600	$ 1.493	0,01
Societa per Azioni Esercizi Aeroportuali SEA SpA				
3,500 % fällig am 09.10.2025		2.800	2.906	0,03
UniCredit SpA				
7,830 % fällig am 04.12.2023	$	62.000	62.373	0,59
			180.178	1,72
STAATSEMISSIONEN				
Italy Government International Bond				
6,875 % fällig am 27.09.2023		10.700	10.723	0,10
Summe Italien			190.901	1,82
JAPAN				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc.				
0,953 % fällig am 19.07.2025		14.400	13.610	0,13
1,538 % fällig am 20.07.2027		9.500	8.390	0,08
2,048 % fällig am 17.07.2030		15.400	12.499	0,12
3,195 % fällig am 18.07.2029		5.600	4.952	0,05
3,273 % fällig am 19.09.2025	€	3.100	3.332	0,03
5,422 % fällig am 22.02.2029	$	2.700	2.687	0,03
5,475 % fällig am 22.02.2031		4.400	4.380	0,04
Mizuho Financial Group, Inc.				
1,979 % fällig am 08.09.2031		7.100	5.615	0,05
2,201 % fällig am 10.07.2031		9.100	7.293	0,07
4,416 % fällig am 20.05.2033	€	5.000	5.464	0,05
5,739 % fällig am 27.05.2031	$	800	799	0,01
Nissan Motor Co. Ltd.				
1,940 % fällig am 15.09.2023	€	16.640	18.076	0,17
3,201 % fällig am 17.09.2028		4.700	4.607	0,04
4,345 % fällig am 17.09.2027	$	14.220	12.943	0,12
4,810 % fällig am 17.09.2030		6.550	5.750	0,06
Nomura Holdings, Inc.				
1,851 % fällig am 16.07.2025		15.950	14.595	0,14
2,172 % fällig am 14.07.2028		5.000	4.223	0,04
2,679 % fällig am 16.07.2030		1.800	1.474	0,01
2,710 % fällig am 22.01.2029		9.800	8.270	0,08
3,103 % fällig am 16.01.2030		4.500	3.840	0,04
5,842 % fällig am 18.01.2028		9.500	9.527	0,09
6,181 % fällig am 18.01.2033		8.000	8.262	0,08
Sumitomo Mitsui Banking Corp.				
2,440 % fällig am 18.06.2024		11.500	11.116	0,11
Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc.				
2,130 % fällig am 08.07.2030		3.500	2.852	0,03
2,696 % fällig am 16.07.2024		4.700	4.549	0,04
2,750 % fällig am 15.01.2030		2.600	2.245	0,02
5,464 % fällig am 13.01.2026		6.000	5.983	0,06
5,520 % fällig am 13.01.2028		5.000	5.024	0,05
5,710 % fällig am 13.01.2030		10.000	10.130	0,10
5,766 % fällig am 13.01.2033		4.500	4.633	0,04
6,439 % fällig am 13.01.2026		1.400	1.412	0,01
Suntory Holdings Ltd.				
2,250 % fällig am 16.10.2024		900	855	0,01
Summe Japan			209.387	2,00
JERSEY, KANALINSELN				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
AA Bond Co. Ltd.				
5,500 % fällig am 31.07.2050	£	7.782	8.631	0,08
G City Europe Ltd.				
4,250 % fällig am 11.09.2025	€	24.900	23.768	0,23
Gatwick Funding Ltd.				
2,500 % fällig am 15.04.2032	£	300	304	0,00
2,625 % fällig am 07.10.2048		1.200	874	0,01
3,125 % fällig am 28.09.2041		1.600	1.377	0,01
Heathrow Funding Ltd.				
1,875 % fällig am 12.07.2032	€	3.800	3.483	0,04
2,750 % fällig am 13.10.2031	£	1.300	1.351	0,01
HSBC Bank Capital Funding Sterling LP				
5,844 % fällig am 05.11.2031 (g)		8.867	11.329	0,11
Summe Jersey, Kanalinseln			51.117	0,49
LUXEMBURG				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Altice Financing S.A.				
4,250 % fällig am 15.08.2029	€	1.300	1.093	0,01
Aroundtown S.A.				
3,000 % fällig am 16.10.2029	£	1.300	$ 1.046	0,01
5,375 % fällig am 21.03.2029	$	16.400	12.152	0,12
Becton Dickinson Euro Finance SARL				
0,334 % fällig am 13.08.2028	€	4.500	4.128	0,04
1,336 % fällig am 13.08.2041		5.180	3.617	0,03
CPI Property Group S.A.				
1,500 % fällig am 27.01.2031		10.500	6.246	0,06
1,750 % fällig am 14.01.2030		10.900	7.218	0,07
Cromwell Ereit Lux Finco SARL				
2,125 % fällig am 19.11.2025		19.575	18.432	0,17
Helvetia Europe S.A.				
2,750 % fällig am 30.09.2041		4.700	4.084	0,04
Logicor Financing SARL				
1,625 % fällig am 15.07.2027		23.950	21.721	0,21
Sberbank of Russia Via SB Capital S.A.				
5,125 % fällig am 29.10.2022 ^	$	61.150	3.669	0,03
5,250 % fällig am 23.05.2023 ^(i)		12.200	732	0,01
TMS Issuer SARL				
5,780 % fällig am 23.08.2032		7.000	7.222	0,07
			91.360	0,87
KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG				
Delos Finance SARL				
7,288 % fällig am 06.10.2023		18.243	18.254	0,17
Summe Luxemburg			109.614	1,04
MAURITIUS				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Greenko Solar Mauritius Ltd.				
5,950 % fällig am 29.07.2026		300	282	0,00
India Green Energy Holdings				
5,375 % fällig am 29.04.2024		9.900	9.681	0,09
Summe Mauritius			9.963	0,09
		AKTIEN		
MEXIKO				
STAMMAKTIEN				
Desarrolladora Homex S.A.B. de C.V. (d)		427.064	0	0,00
		PAR (000S)		
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Banco Mercantil del Norte S.A.				
6,625 % fällig am 24.01.2032 (g)(i)	$	9.600	7.430	0,07
Petroleos Mexicanos				
2,750 % fällig am 21.04.2027	€	200	174	0,00
3,750 % fällig am 21.02.2024		100	108	0,00
4,875 % fällig am 21.02.2028		500	453	0,00
10,000 % fällig am 07.02.2033	$	8.100	7.427	0,07
Trust Fibra Uno				
4,869 % fällig am 15.01.2030		1.900	1.680	0,02
			17.272	0,16
Summe Mexiko			17.272	0,16
MULTINATIONAL				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Delta Air Lines, Inc.				
4,750 % fällig am 20.10.2028		3.600	3.497	0,03
NIEDERLANDE				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
ABN AMRO Bank NV				
4,375 % fällig am 22.09.2025 (g)(i)	€	9.700	9.557	0,09
Arcadis NV				
4,875 % fällig am 28.02.2028		7.000	7.638	0,07
ASR Nederland NV				
3,375 % fällig am 02.05.2049		4.300	4.082	0,04
7,000 % fällig am 07.12.2043		2.700	3.071	0,03
BAT Netherlands Finance BV				
5,375 % fällig am 16.02.2031		5.300	5.780	0,06
BP Capital Markets BV				
4,323 % fällig am 12.05.2035		2.500	2.726	0,03
Cooperatieve Rabobank UA				
4,375 % fällig am 29.06.2027 (g)(i)	€	19.200	$ 18.339	0,17
4,655 % fällig am 22.08.2028	$	6.800	6.514	0,06
CTP NV				
0,500 % fällig am 21.06.2025	€	9.400	9.144	0,09
1,250 % fällig am 21.06.2029		12.800	10.145	0,10
Digital Dutch Finco BV				
1,000 % fällig am 15.01.2032		2.600	2.006	0,02
1,250 % fällig am 01.02.2031		12.400	10.114	0,10
EnBW International Finance BV				
3,500 % fällig am 24.07.2028		5.000	5.360	0,05
4,000 % fällig am 24.01.2035		7.300	7.795	0,07
Enel Finance International NV				
1,875 % fällig am 12.07.2028	$	600	504	0,00
5,500 % fällig am 15.06.2052		5.000	4.520	0,04
IMCD NV				
2,500 % fällig am 26.03.2025	€	4.700	4.965	0,05
ING Groep NV				
4,875 % fällig am 16.05.2029 (g)(i)	$	21.300	16.554	0,16
5,750 % fällig am 16.11.2026 (g)(i)		10.000	8.840	0,08
6,250 % fällig am 20.05.2033	£	5.200	6.133	0,06
JAB Holdings BV				
1,000 % fällig am 20.12.2027	€	5.000	4.759	0,05
2,200 % fällig am 23.11.2030	$	20.150	15.863	0,15
2,250 % fällig am 19.12.2039	€	4.800	3.716	0,04
5,000 % fällig am 12.06.2033		3.600	3.991	0,04
LeasePlan Corp. NV				
0,125 % fällig am 13.09.2023		6.340	6.865	0,07
2,875 % fällig am 24.10.2024	$	1.020	972	0,01
7,375 % fällig am 29.05.2024 (g)(i)	€	1.000	1.073	0,01
NE Property BV				
1,875 % fällig am 09.10.2026		3.500	3.316	0,03
2,000 % fällig am 20.01.2030		7.000	5.651	0,05
3,375 % fällig am 14.07.2027		9.300	9.118	0,09
NN Group NV				
4,625 % fällig am 13.01.2048		2.000	2.109	0,02
Prosus NV				
1,539 % fällig am 03.08.2028		3.700	3.328	0,03
2,031 % fällig am 03.08.2032		25.780	20.035	0,19
4,027 % fällig am 03.08.2050	$	3.800	2.390	0,02
4,193 % fällig am 19.01.2032		3.800	3.202	0,03
Sagax Euro MTN NL BV				
0,750 % fällig am 26.01.2028	€	6.100	5.049	0,05
1,625 % fällig am 24.02.2026		5.900	5.766	0,05
Siemens Energy Finance BV				
4,250 % fällig am 05.04.2029		1.800	1.913	0,02
Syngenta Finance NV				
3,375 % fällig am 16.04.2026		7.100	7.438	0,07
4,892 % fällig am 24.04.2025	$	6.784	6.645	0,06
Volkswagen Financial Services NV				
0,875 % fällig am 20.02.2025	£	7.000	8.105	0,08
1,125 % fällig am 18.09.2023		13.700	17.244	0,16
1,875 % fällig am 03.12.2024		1.800	2.140	0,02
Vonovia Finance BV				
0,500 % fällig am 14.09.2029	€	500	409	0,00
1,125 % fällig am 14.09.2034		1.000	712	0,01
WPC Eurobond BV				
1,350 % fällig am 15.04.2028		5.400	5.010	0,05
			290.606	2,77
NON-AGENCY-MBS				
EMF-NL Prime BV				
3,977 % fällig am 17.04.2041		395	411	0,01
Eurosail BV				
4,677 % fällig am 17.10.2040		129	141	0,00
			552	0,01
STAATSEMISSIONEN				
BNG Bank NV				
2,375 % fällig am 16.03.2026	$	9.300	8.741	0,08
Summe Niederlande			299.899	2,86
NORWEGEN				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Var Energi ASA				
8,000 % fällig am 15.11.2032		5.000	5.303	0,05

BESCHREIBUNG		PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
Yara International ASA				
4,750 % fällig am 01.06.2028	$	15.300	$ 14.548	0,14
Summe Norwegen			19.851	0,19
PERU				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Banco de Credito del Peru S.A.				
4,650 % fällig am 17.09.2024	PEN	9.800	2.592	0,03
STAATSEMISSIONEN				
Peru Government International Bond				
6,350 % fällig am 12.08.2028		23.400	6.550	0,06
7,300 % fällig am 12.08.2033		213	61	0,00
			6.611	0,06
Summe Peru			9.203	0,09
POLEN				
STAATSEMISSIONEN				
Poland Government International Bond				
3,875 % fällig am 14.02.2033	€	7.400	8.020	0,08
4,250 % fällig am 14.02.2043		2.300	2.469	0,02
Summe Polen			10.489	0,10
KATAR				
STAATSEMISSIONEN				
Qatar Government International Bond				
4,400 % fällig am 16.04.2050	$	11.300	10.303	0,10
RUMÄNIEN				
STAATSEMISSIONEN				
Romania Government International Bond				
1,375 % fällig am 02.12.2029	€	3.425	2.905	0,03
1,750 % fällig am 13.07.2030		7.650	6.381	0,06
2,125 % fällig am 07.03.2028		7.200	6.834	0,07
2,625 % fällig am 02.12.2040		22.600	15.055	0,14
2,875 % fällig am 13.04.2042		8.200	5.513	0,05
Summe Rumänien			36.688	0,35
RUSSLAND				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
MMK International Capital DAC				
4,375 % fällig am 13.06.2024 ^	$	4.900	294	0,00
SAUDI-ARABIEN				
STAATSEMISSIONEN				
Saudi Arabia Government International Bond				
2,250 % fällig am 02.02.2033		20.200	16.298	0,16
4,750 % fällig am 18.01.2028		52.000	51.620	0,49
4,875 % fällig am 18.07.2033		25.000	25.005	0,24
5,000 % fällig am 18.01.2053		6.000	5.567	0,05
Summe Saudi-Arabien			98.490	0,94
SINGAPUR				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Oversea-Chinese Banking Corp. Ltd.				
1,832 % fällig am 10.09.2030 (i)		13.500	12.315	0,12
Pfizer Investment Enterprises Pte. Ltd.				
4,750 % fällig am 19.05.2033		5.000	4.983	0,05
5,110 % fällig am 19.05.2043		18.100	18.153	0,17
SP PowerAssets Ltd.				
3,000 % fällig am 26.09.2027		2.400	2.237	0,02
United Overseas Bank Ltd.				
1,750 % fällig am 16.03.2031 (i)		3.500	3.116	0,03
Summe Singapur			40.804	0,39
SLOWAKEI				
STAATSEMISSIONEN				
Slovakia Government International Bond				
1,875 % fällig am 09.03.2037	€	500	436	0,00
SLOWENIEN				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Nova Kreditna Banka Maribor d.d.				
1,875 % fällig am 27.01.2025		10.700	11.292	0,11

BESCHREIBUNG		PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
SÜDAFRIKA				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
AngloGold Ashanti Holdings PLC				
3,375 % fällig am 01.11.2028	$	5.500	$ 4.823	0,05
3,750 % fällig am 01.10.2030		7.800	6.701	0,06
			11.524	0,11
STAATSEMISSIONEN				
South Africa Government International Bond				
10,500 % fällig am 21.12.2026	ZAR	1.231.200	67.685	0,64
Summe Südafrika			79.209	0,75
SÜDKOREA				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Shinhan Bank Co. Ltd.				
1,183 % fällig am 29.09.2025	AUD	7.200	4.359	0,04
Shinhan Financial Group Co. Ltd.				
3,340 % fällig am 05.02.2030 (i)	$	3.000	2.873	0,03
Summe Südkorea			7.232	0,07
SPANIEN				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A.				
5,875 % fällig am 24.09.2023 (g)(i)	€	3.200	3.463	0,03
CaixaBank S.A.				
3,625 % fällig am 14.09.2028 (g)(i)		5.400	4.020	0,04
Werfen S.A.				
4,625 % fällig am 06.06.2028		11.100	11.959	0,12
Summe Spanien			19.442	0,19
ÜBERNATIONAL				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Europäische Bank für Wiederaufbau und Entwicklung				
1,500 % fällig am 13.02.2025	$	5.200	4.910	0,05
1,625 % fällig am 27.09.2024		500	478	0,01
Europäische Investitionsbank				
0,750 % fällig am 15.11.2024	£	15.350	18.242	0,17
Summe Supranational			23.630	0,23
SCHWEDEN				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Castellum AB				
2,125 % fällig am 20.11.2023	€	4.300	4.621	0,04
Fastighets AB Balder				
1,125 % fällig am 29.01.2027		4.500	3.702	0,04
Sagax AB				
1,125 % fällig am 30.01.2027		4.200	3.867	0,04
2,250 % fällig am 13.03.2025		8.400	8.659	0,08
Summe Schweden			20.849	0,20
SCHWEIZ				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Credit Suisse AG				
6,500 % fällig am 08.08.2023 (i)	$	95.950	95.601	0,91
UBS Group AG				
1,494 % fällig am 10.08.2027		5.000	4.298	0,04
2,593 % fällig am 11.09.2025		18.030	17.193	0,17
3,126 % fällig am 13.08.2030		400	337	0,00
4,125 % fällig am 24.09.2025		58.990	56.395	0,54
4,177 % fällig am 16.01.2026	€	3.550	3.814	0,04
4,750 % fällig am 17.03.2032		12.900	14.034	0,13
Summe Schweiz			191.672	1,83
THAILAND				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Bangkok Bank PCL				
3,466 % fällig am 23.09.2036 (i)	$	9.200	7.507	0,07

BESCHREIBUNG		PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
TÜRKEI				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Turkish Airlines Pass-Through Trust				
4,200 % fällig am 15.09.2028	$	4.094	$ 3.772	0,04
VEREINIGTE ARABISCHE EMIRATE				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
DAE Sukuk Difc Ltd.				
3,750 % fällig am 15.02.2026		8.600	8.184	0,08
GROSSBRITANNIEN				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Barclays PLC				
2,645 % fällig am 24.06.2031		8.000	6.422	0,06
4,375 % fällig am 12.01.2026		9.860	9.477	0,09
5,501 % fällig am 09.08.2028		7.550	7.369	0,07
6,224 % fällig am 09.05.2034		5.900	5.880	0,06
7,750 % fällig am 15.09.2023 (g)(i)		700	688	0,01
8,000 % fällig am 15.06.2024 (g)(i)		4.300	4.074	0,04
BAT International Finance PLC				
1,668 % fällig am 25.03.2026		5.990	5.388	0,05
2,250 % fällig am 26.06.2028	£	8.100	8.232	0,08
BP Capital Markets PLC				
5,773 % fällig am 25.05.2038		1.200	1.505	0,01
Broadgate Financing PLC				
4,851 % fällig am 05.04.2033		49	59	0,00
Cadent Finance PLC				
2,625 % fällig am 22.09.2038		300	246	0,00
2,750 % fällig am 22.09.2046		3.200	2.368	0,02
Chanel Ceres PLC				
0,500 % fällig am 31.07.2026	€	11.800	11.477	0,11
1,000 % fällig am 31.07.2031		6.800	5.925	0,06
Connect Plus M25 Issuer PLC				
2,607 % fällig am 31.03.2039	£	2.022	2.000	0,02
Direct Line Insurance Group PLC				
4,000 % fällig am 05.06.2032		1.200	1.104	0,01
DWR Cymru Financing UK PLC				
3,514 % fällig am 31.03.2030		31	44	0,00
Ferguson Finance PLC				
3,250 % fällig am 02.06.2030	$	4.300	3.737	0,04
Gazprom PJSC Via Gaz Finance PLC				
3,250 % fällig am 25.02.2030		7.700	4.889	0,05
Greene King Finance PLC				
0,000 % fällig am 15.03.2036	£	900	864	0,01
4,064 % fällig am 15.03.2035		4.469	4.659	0,04
5,106 % fällig am 15.03.2034		89	100	0,00
5,318 % fällig am 15.09.2031		221	253	0,00
HSBC Holdings PLC				
1,750 % fällig am 24.07.2027		19.060	20.661	0,20
2,357 % fällig am 18.08.2031	$	6.600	5.272	0,05
2,848 % fällig am 04.06.2031		8.500	7.058	0,07
3,973 % fällig am 22.05.2030		11.300	10.158	0,10
4,041 % fällig am 13.03.2028		17.400	16.309	0,16
4,292 % fällig am 12.09.2026		2.500	2.405	0,02
4,600 % fällig am 17.12.2030 (g)(i)		11.900	9.089	0,09
6,920 % fällig am 12.09.2026		526	530	0,01
Imperial Brands Finance PLC				
3,125 % fällig am 26.07.2024		1.300	1.256	0,01
3,500 % fällig am 26.07.2026		21.660	20.187	0,19
3,875 % fällig am 26.07.2029		11.840	10.446	0,10
Informa PLC				
1,250 % fällig am 22.04.2028	€	9.200	8.720	0,08
1,500 % fällig am 05.07.2023		7.818	8.529	0,08
2,125 % fällig am 06.10.2025		17.190	17.895	0,17
3,125 % fällig am 05.07.2026	£	100	114	0,00
InterContinental Hotels Group PLC				
1,625 % fällig am 08.10.2024	€	15.000	15.819	0,15
3,375 % fällig am 08.10.2028	£	7.800	8.423	0,08
John Lewis PLC				
4,250 % fällig am 18.12.2034		2.800	2.221	0,02
6,125 % fällig am 21.01.2025		2.050	2.511	0,02
Lloyds Bank PLC				
0,000 % fällig am 02.04.2032	$	24.800	15.551	0,15
Lloyds Banking Group PLC				
4,947 % fällig am 27.06.2025 (g)(i)	€	5.200	5.186	0,05
M&G PLC				
6,340 % fällig am 19.12.2063	£	500	550	0,01

BESCHREIBUNG		PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
Market Bidco Finco PLC				
4,750 % fällig am 04.11.2027	€	11.500	$10.132	0,10
Marks & Spencer PLC				
3,750 % fällig am 19.05.2026	£	100	115	0,00
Mitchells & Butlers Finance PLC				
5,451 % fällig am 15.12.2030		583	687	0,01
6,013 % fällig am 15.12.2030		418	478	0,00
National Grid Electricity Distribution East Midlands PLC				
3,530 % fällig am 20.09.2028	€	3.000	3.189	0,03
National Grid PLC				
5,602 % fällig am 12.06.2028	$	1.400	1.407	0,01
5,809 % fällig am 12.06.2033		21.500	21.893	0,21
Nationwide Building Society				
5,875 % fällig am 20.12.2024 (g)(i)	£	8.150	9.689	0,09
NatWest Group PLC				
4,269 % fällig am 22.03.2025	$	8.800	8.646	0,08
4,800 % fällig am 05.04.2026		3.800	3.691	0,04
4,892 % fällig am 18.05.2029		8.625	8.214	0,08
5,076 % fällig am 27.01.2030		8.560	8.173	0,08
6,016 % fällig am 02.03.2034		25.900	26.056	0,25
Northumbrian Water Finance PLC				
4,500 % fällig am 14.02.2031	£	4.200	4.787	0,05
Quadgas Finance PLC				
3,375 % fällig am 17.09.2029		300	303	0,00
Royalty Pharma PLC				
2,200 % fällig am 02.09.2030	$	5.700	4.585	0,04
3,300 % fällig am 02.09.2040		5.000	3.563	0,03
Sage Group PLC				
1,625 % fällig am 25.02.2031	£	1.500	1.402	0,01
3,820 % fällig am 15.02.2028	€	2.700	2.910	0,03
Santander UK Group Holdings PLC				
2,896 % fällig am 15.03.2032	$	500	405	0,00
2,920 % fällig am 08.05.2026	£	2.700	3.151	0,03
3,530 % fällig am 25.08.2028	€	2.000	2.057	0,02
6,750 % fällig am 24.06.2024 (g)(i)	£	12.950	15.443	0,15
Santander UK PLC				
5,234 % fällig am 12.02.2027		11.800	15.025	0,14
Standard Chartered PLC				
1,456 % fällig am 14.01.2027	$	16.100	14.284	0,14
2,819 % fällig am 30.01.2026		2.300	2.170	0,02
3,265 % fällig am 18.02.2036		5.700	4.490	0,04
3,603 % fällig am 12.01.2033		5.900	4.729	0,04
4,644 % fällig am 01.04.2031		2.700	2.493	0,02
6,296 % fällig am 06.07.2034 (b)		600	601	0,01
6,301 % fällig am 09.01.2029		12.000	12.076	0,11
Telereal Secured Finance PLC				
4,010 % fällig am 10.12.2033	£	224	252	0,00
Thames Water Utilities Finance PLC				
4,375 % fällig am 18.01.2031	€	3.000	2.920	0,03
TP ICAP Finance PLC				
2,625 % fällig am 18.11.2028	£	5.900	5.545	0,05
5,250 % fällig am 29.05.2026		16.900	19.797	0,19
7,875 % fällig am 17.04.2030		4.800	5.789	0,06
Virgin Money UK PLC				
2,875 % fällig am 24.06.2025	€	6.700	7.084	0,07
3,375 % fällig am 24.04.2026	£	2.300	2.662	0,03
4,000 % fällig am 03.09.2027		1.000	1.113	0,01
4,625 % fällig am 29.10.2028	€	500	513	0,00
Weir Group PLC				
2,200 % fällig am 13.05.2026	$	8.500	7.618	0,07
			525.787	5,01
NON-AGENCY-MBS				
Canary Wharf Finance PLC				
5,952 % fällig am 22.10.2037	£	55	69	0,00
Great Hall Mortgages PLC				
5,644 % fällig am 18.06.2039	$	560	554	0,01
Newgate Funding PLC				
5,038 % fällig am 01.12.2050	£	122	146	0,00
			769	0,01
Summe Großbritannien			526.556	5,02

BESCHREIBUNG		PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
USA				
FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE				
AASET Trust				
3,967 % fällig am 16.05.2042	$	2.056	1.715	0,02
ACE Securities Corp. Home Equity Loan Trust				
6,050 % fällig am 25.12.2034	$	1.000	$896	0,01
6,095 % fällig am 25.05.2035		1.900	1.694	0,02
Aegis Asset-Backed Securities Trust				
5,320 % fällig am 25.01.2037		3.741	2.844	0,03
Ameriquest Mortgage Securities Trust				
5,735 % fällig am 25.03.2036		26	26	0,00
Ameriquest Mortgage Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates				
5,855 % fällig am 25.01.2036		956	951	0,01
Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp.				
4,001 % fällig am 25.08.2032		98	93	0,00
First Franklin Mortgage Loan Trust				
5,870 % fällig am 25.10.2035		11	11	0,00
Fremont Home Loan Trust				
5,470 % fällig am 25.08.2036		6.989	2.344	0,02
GSAMP Trust				
5,320 % fällig am 25.01.2037		1.303	1.253	0,01
Home Equity Mortgage Loan Asset-Backed Trust				
5,340 % fällig am 25.04.2037		4.724	3.083	0,03
JPMorgan Mortgage Acquisition Trust				
5,360 % fällig am 25.10.2036		1.078	1.061	0,01
L2L Education Loan Trust				
5,533 % fällig am 15.06.2031		1.118	1.117	0,01
Labrador Aviation Finance Ltd.				
4,300 % fällig am 15.01.2042		12.687	10.511	0,10
Long Beach Mortgage Loan Trust				
5,310 % fällig am 25.12.2036		4.217	2.892	0,03
6,200 % fällig am 25.06.2035		4.324	4.185	0,04
MASTR Asset-Backed Securities Trust				
5,870 % fällig am 25.12.2034		1.719	1.586	0,01
Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust				
6,200 % fällig am 25.04.2035		1.704	1.585	0,02
New Century Home Equity Loan Trust				
6,080 % fällig am 25.11.2034		223	214	0,00
Option One Mortgage Loan Trust				
5,290 % fällig am 25.01.2037		4.609	2.646	0,03
Residential Asset Mortgage Products Trust				
5,610 % fällig am 25.12.2035		384	308	0,00
Residential Asset Securities Corp. Trust				
5,810 % fällig am 25.11.2035		370	368	0,00
Securitized Asset-Backed Receivables LLC Trust				
5,730 % fällig am 25.12.2035		426	411	0,00
5,825 % fällig am 25.01.2035		94	88	0,00
SLM Private Credit Student Loan Trust				
5,792 % fällig am 16.12.2041		1.423	1.368	0,01
Soundview Home Loan Trust				
5,610 % fällig am 25.06.2036		3.914	3.740	0,04
Structured Asset Investment Loan Trust				
5,770 % fällig am 25.01.2036		3.659	3.369	0,03
			50.359	0,48
		AKTIEN		
STAMMAKTIEN				
FINANZWERTE				
Stearns Holdings LLC 'B' (d)		1.508.783	0	0,00
		PAR (000S)		
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
7-Eleven, Inc.				
1,800 % fällig am 10.02.2031	$	2.150	1.701	0,02
Adventist Health System				
5,430 % fällig am 01.03.2032		2.000	1.984	0,02
AEP Texas, Inc.				
2,100 % fällig am 01.07.2030		7.935	6.487	0,06
AES Corp.				
3,300 % fällig am 15.07.2025		9.500	8.980	0,09
3,950 % fällig am 15.07.2030		6.000	5.385	0,05
Alaska Airlines Pass-Through Trust				
4,800 % fällig am 15.02.2029		7.839	7.541	0,07
Alexandria Real Estate Equities, Inc.				
4,300 % fällig am 15.01.2026		12.150	11.726	0,11
Allegion U.S. Holding Co., Inc.				
3,550 % fällig am 01.10.2027		9.800	9.071	0,09

BESCHREIBUNG		PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
Ally Financial, Inc.				
2,200 % fällig am 02.11.2028	$	800	$639	0,01
6,992 % fällig am 13.06.2029		6.000	5.931	0,06
8,000 % fällig am 01.11.2031		12.265	12.731	0,12
American Airlines Pass-Through Trust				
3,000 % fällig am 15.04.2030		2.090	1.856	0,02
3,150 % fällig am 15.08.2033		6.937	6.057	0,06
3,200 % fällig am 15.12.2029		9.743	8.743	0,08
3,250 % fällig am 15.04.2030		1.568	1.330	0,01
3,350 % fällig am 15.04.2031		7.586	6.753	0,06
3,375 % fällig am 01.11.2028		8.371	7.516	0,07
3,500 % fällig am 15.08.2033		11.513	9.405	0,09
3,575 % fällig am 15.07.2029		2.003	1.858	0,02
3,600 % fällig am 22.03.2029		936	871	0,01
3,600 % fällig am 15.04.2031		4.158	3.514	0,03
3,650 % fällig am 15.08.2030		1.362	1.256	0,01
4,000 % fällig am 15.01.2027		2.263	2.044	0,02
4,100 % fällig am 15.07.2029		1.026	912	0,01
American Electric Power Co., Inc.				
3,875 % fällig am 15.02.2062		6.200	4.955	0,05
4,300 % fällig am 01.12.2028		4.600	4.391	0,04
5,625 % fällig am 01.03.2033		1.700	1.729	0,02
American Homes 4 Rent LP				
4,250 % fällig am 15.02.2028		500	471	0,00
4,900 % fällig am 15.02.2029		9.200	8.847	0,08
American Tower Corp.				
0,500 % fällig am 15.01.2028	€	17.900	16.434	0,16
1,000 % fällig am 15.01.2032		11.300	9.233	0,09
1,375 % fällig am 04.04.2025		800	828	0,01
1,450 % fällig am 15.09.2026	$	5.900	5.196	0,05
1,875 % fällig am 15.10.2030		4.800	3.793	0,04
1,950 % fällig am 22.05.2026	€	8.800	8.940	0,09
2,100 % fällig am 15.06.2030	$	6.500	5.258	0,05
2,300 % fällig am 15.09.2031		3.900	3.107	0,03
2,400 % fällig am 15.03.2025		3.800	3.580	0,03
2,950 % fällig am 15.01.2025		9.670	9.253	0,09
3,125 % fällig am 15.01.2027		5.900	5.442	0,05
3,800 % fällig am 15.08.2029		9.134	8.344	0,08
3,950 % fällig am 15.03.2029		600	554	0,01
5,250 % fällig am 15.07.2028		3.000	2.968	0,03
5,550 % fällig am 15.07.2033		1.000	1.008	0,01
5,650 % fällig am 15.03.2033		9.000	9.135	0,09
American Transmission Systems, Inc.				
5,000 % fällig am 01.09.2044		1.539	1.436	0,01
Amgen, Inc.				
5,250 % fällig am 02.03.2030		5.000	5.014	0,05
5,600 % fällig am 02.03.2043		36.650	36.786	0,35
5,650 % fällig am 02.03.2053		5.900	5.979	0,06
5,750 % fällig am 02.03.2063		10.000	10.152	0,10
Anheuser-Busch Cos. LLC				
4,900 % fällig am 01.02.2046		1.800	1.722	0,02
Anheuser-Busch InBev Worldwide, Inc.				
4,600 % fällig am 15.04.2048		6.098	5.666	0,05
5,450 % fällig am 23.01.2039		7.000	7.249	0,07
Antares Holdings LP				
2,750 % fällig am 15.01.2027		5.800	4.770	0,05
3,950 % fällig am 15.07.2026		3.500	3.075	0,03
Apple, Inc.				
4,300 % fällig am 10.05.2033		3.000	2.985	0,03
Ares Capital Corp.				
2,875 % fällig am 15.06.2027		8.500	7.373	0,07
Ares Finance Co. LLC				
3,250 % fällig am 15.06.2030		15.600	13.147	0,13
Ashtead Capital, Inc.				
1,500 % fällig am 12.08.2026		1.400	1.224	0,01
4,000 % fällig am 01.05.2028		7.041	6.529	0,06
AT&T, Inc.				
3,550 % fällig am 15.09.2055		9.608	6.733	0,06
3,650 % fällig am 15.09.2059		15.243	10.623	0,10
4,300 % fällig am 18.11.2034	€	3.400	3.721	0,04
Aviation Capital Group LLC				
3,500 % fällig am 01.11.2027	$	8.302	7.339	0,07
4,375 % fällig am 30.01.2024		13.999	13.773	0,13
5,500 % fällig am 15.12.2024		2.600	2.546	0,02
Bank of America Corp.				
0,580 % fällig am 08.08.2029	€	9.500	8.603	0,08
1,898 % fällig am 23.07.2031	$	4.200	3.347	0,03
2,551 % fällig am 04.02.2028		26.100	23.576	0,22
2,592 % fällig am 29.04.2031		15.000	12.601	0,12

BESCHREIBUNG		PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
2,651 % fällig am 11.03.2032	$	10.000	$ 8.286	0,08
2,687 % fällig am 22.04.2032		3.400	2.819	0,03
4,271 % fällig am 23.07.2029		2.300	2.184	0,02
4,300 % fällig am 28.01.2025 (g)		27.900	24.970	0,24
5,015 % fällig am 22.07.2033		5.000	4.894	0,05
6,233 % fällig am 23.07.2024		35.600	35.611	0,34
Bank of America N.A.				
6,000 % fällig am 15.10.2036		7.150	7.647	0,07
BAT Capital Corp.				
2,726 % fällig am 25.03.2031		6.500	5.180	0,05
Bayer U.S. Finance LLC				
4,250 % fällig am 15.12.2025		400	386	0,00
4,375 % fällig am 15.12.2028		22.680	21.526	0,21
6,562 % fällig am 15.12.2023		6.900	6.893	0,07
Becton Dickinson & Co.				
0,034 % fällig am 13.08.2025	€	2.300	2.310	0,02
Berry Global, Inc.				
1,000 % fällig am 15.01.2025		9.900	10.286	0,10
1,500 % fällig am 15.01.2027		9.100	8.934	0,09
4,875 % fällig am 15.07.2026	$	3.100	2.983	0,03
BGC Partners, Inc.				
8,000 % fällig am 25.05.2028		5.600	5.416	0,05
Black Hills Corp.				
1,037 % fällig am 23.08.2024		1.200	1.134	0,01
4,250 % fällig am 30.11.2023		2.500	2.483	0,02
5,950 % fällig am 15.03.2028		2.990	3.027	0,03
Blackstone Private Credit Fund				
2,350 % fällig am 22.11.2024		13.100	12.246	0,12
Boeing Co.				
2,196 % fällig am 04.02.2026		23.500	21.578	0,21
3,250 % fällig am 01.02.2028		4.400	4.043	0,04
5,150 % fällig am 01.05.2030		1.706	1.691	0,02
5,930 % fällig am 01.05.2060		5.000	4.956	0,05
Booking Holdings, Inc.				
4,125 % fällig am 12.05.2033	€	1.900	2.064	0,02
Boston Scientific Corp.				
2,650 % fällig am 01.06.2030	$	5.900	5.144	0,05
BP Capital Markets America, Inc.				
4,812 % fällig am 13.02.2033		2.000	1.972	0,02
British Airways Pass-Through Trust				
3,300 % fällig am 15.06.2034		11.816	10.273	0,10
3,350 % fällig am 15.12.2030		789	690	0,01
3,800 % fällig am 20.03.2033		68	62	0,00
4,125 % fällig am 20.03.2033		68	61	0,00
4,250 % fällig am 15.05.2034		674	616	0,01
4,625 % fällig am 20.12.2025		574	567	0,01
Broadcom, Inc.				
2,450 % fällig am 15.02.2031		12.900	10.497	0,10
2,600 % fällig am 15.02.2033		3.300	2.581	0,02
3,187 % fällig am 15.11.2036		34.991	26.464	0,25
3,469 % fällig am 15.04.2034		18.649	15.305	0,15
3,500 % fällig am 15.02.2041		200	150	0,00
4,926 % fällig am 15.05.2037		17.568	15.909	0,15
Brookfield Capital Finance LLC				
6,087 % fällig am 14.06.2033		7.700	7.823	0,07
Brooklyn Union Gas Co.				
3,865 % fällig am 04.03.2029		500	455	0,00
Burlington Northern Santa Fe LLC				
4,450 % fällig am 15.01.2053		344	315	0,00
5,200 % fällig am 15.04.2054		11.056	11.288	0,11
Caesars Entertainment, Inc.				
7,000 % fällig am 15.02.2030		8.500	8.544	0,08
Cameron LNG LLC				
3,402 % fällig am 15.01.2038		4.300	3.587	0,03
3,701 % fällig am 15.01.2039		8.325	6.881	0,07
Cantor Fitzgerald LP				
4,500 % fällig am 14.04.2027		100	94	0,00
4,875 % fällig am 01.05.2024		3.500	3.425	0,03
Capital One Financial Corp.				
6,312 % fällig am 08.06.2029		9.800	9.742	0,09
Carlyle Holdings Finance LLC				
5,625 % fällig am 30.03.2043		100	88	0,00
CDW LLC				
3,569 % fällig am 01.12.2031		6.500	5.494	0,05
Centene Corp.				
2,450 % fällig am 15.07.2028		20.800	17.799	0,17
3,000 % fällig am 15.10.2030		21.000	17.519	0,17

BESCHREIBUNG		PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
Charter Communications Operating LLC				
2,250 % fällig am 15.01.2029	$	7.920	$ 6.599	0,06
2,300 % fällig am 01.02.2032		11.000	8.333	0,08
3,500 % fällig am 01.06.2041		9.200	6.231	0,06
3,700 % fällig am 01.04.2051		6.800	4.302	0,04
3,900 % fällig am 01.06.2052		1.700	1.114	0,01
4,400 % fällig am 01.12.2061		750	507	0,00
4,800 % fällig am 01.03.2050		8.400	6.345	0,06
5,125 % fällig am 01.07.2049		12.300	9.687	0,09
5,375 % fällig am 01.04.2038		6.300	5.372	0,05
Cheniere Corpus Christi Holdings LLC				
3,700 % fällig am 15.11.2029		9.000	8.157	0,08
5,125 % fällig am 30.06.2027		13.132	12.918	0,12
Cheniere Energy Partners LP				
3,250 % fällig am 31.01.2032		6.600	5.439	0,05
4,000 % fällig am 01.03.2031		11.900	10.491	0,10
5,950 % fällig am 30.06.2033		9.900	9.941	0,09
Choice Hotels International, Inc.				
3,700 % fällig am 01.12.2029		700	604	0,01
Citigroup, Inc.				
2,572 % fällig am 03.06.2031 (j)		24.700	20.619	0,20
Cleveland Electric Illuminating Co.				
3,500 % fällig am 01.04.2028		2.965	2.720	0,03
Comcast Corp.				
5,350 % fällig am 15.05.2053		13.100	13.313	0,13
Constellation Energy Generation LLC				
5,600 % fällig am 01.03.2028		1.600	1.613	0,02
5,750 % fällig am 01.10.2041		2.500	2.450	0,02
Continental Resources, Inc.				
2,875 % fällig am 01.04.2032		15.595	11.992	0,11
5,750 % fällig am 15.01.2031		300	285	0,00
Corporate Office Properties LP				
2,250 % fällig am 15.03.2026		5.200	4.610	0,04
CoStar Group, Inc.				
2,800 % fällig am 15.07.2030		5.200	4.295	0,04
Cox Communications, Inc.				
5,450 % fällig am 15.09.2028		3.500	3.498	0,03
Credit Suisse AG AT1 Claim ^		22.000	880	0,01
Crown Castle Towers LLC				
4,241 % fällig am 15.07.2048		5.800	5.391	0,05
Crown Castle, Inc.				
2,250 % fällig am 15.01.2031		12.500	10.199	0,10
3,100 % fällig am 15.11.2029		12.805	11.167	0,11
3,250 % fällig am 15.01.2051		5.400	3.687	0,04
3,800 % fällig am 15.02.2028		3.765	3.513	0,03
4,300 % fällig am 15.02.2029		4.000	3.766	0,04
CVS Health Corp.				
5,000 % fällig am 30.01.2029		7.000	6.936	0,07
5,250 % fällig am 30.01.2031		12.400	12.365	0,12
CVS Pass-Through Trust				
4,704 % fällig am 10.01.2036		208	192	0,00
5,926 % fällig am 10.01.2034		1.926	1.829	0,02
6,036 % fällig am 10.12.2028		1.096	1.087	0,01
7,507 % fällig am 10.01.2032		1.255	1.309	0,01
8,353 % fällig am 10.07.2031		230	247	0,00
DAE Funding LLC				
1,550 % fällig am 01.08.2024		6.333	6.014	0,06
1,625 % fällig am 15.02.2024		3.100	2.989	0,03
3,375 % fällig am 20.03.2028		24.600	22.197	0,21
Daimler Truck Finance North America LLC				
1,625 % fällig am 13.12.2024		2.900	2.731	0,03
2,000 % fällig am 14.12.2026		7.510	6.709	0,06
Dell International LLC				
4,900 % fällig am 01.10.2026		11.010	10.937	0,10
5,300 % fällig am 01.10.2029		4.500	4.470	0,04
6,020 % fällig am 15.06.2026		23.099	23.489	0,22
Delta Air Lines, Inc.				
2,900 % fällig am 28.10.2024		14.442	13.877	0,13
3,750 % fällig am 28.10.2029		18.900	17.014	0,16
Digital Realty Trust LP				
5,550 % fällig am 15.01.2028		5.000	4.931	0,05
Discovery Communications LLC				
2,500 % fällig am 20.09.2024	£	2.400	2.902	0,03
DISH DBS Corp.				
5,250 % fällig am 01.12.2026	$	3.100	2.493	0,02
5,750 % fällig am 01.12.2028		3.100	2.312	0,02

BESCHREIBUNG		PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
Doctors Co. An Interinsurance Exchange				
4,500 % fällig am 18.01.2032	$	900	$ 715	0,01
DTE Electric Co.				
1,900 % fällig am 01.04.2028		4.700	4.116	0,04
5,200 % fällig am 01.04.2033		3.500	3.558	0,03
Duke Energy Carolinas LLC				
4,000 % fällig am 30.09.2042		122	101	0,00
Duke Energy Corp.				
3,850 % fällig am 15.06.2034	€	16.000	15.964	0,15
4,300 % fällig am 15.03.2028	$	3.613	3.473	0,03
Duke Energy Indiana LLC				
5,400 % fällig am 01.04.2053		1.218	1.230	0,01
Duke Energy Ohio, Inc.				
5,650 % fällig am 01.04.2053		1.868	1.918	0,02
Duke Energy Progress LLC				
5,250 % fällig am 15.03.2033		5.283	5.371	0,05
Edison International				
8,125 % fällig am 15.06.2053		1.230	1.258	0,01
Enel Finance America LLC				
7,100 % fällig am 14.10.2027		2.800	2.944	0,03
Energy Transfer LP				
4,400 % fällig am 15.03.2027		6.745	6.453	0,06
5,150 % fällig am 01.02.2043		2.294	1.952	0,02
5,150 % fällig am 15.03.2045		7.503	6.481	0,06
5,300 % fällig am 01.04.2044		4.130	3.586	0,03
5,300 % fällig am 15.04.2047		675	588	0,01
5,350 % fällig am 15.05.2045		7.181	6.286	0,06
7,500 % fällig am 01.07.2038		5.734	6.295	0,06
7,600 % fällig am 01.02.2024		10.400	10.462	0,10
Entergy Louisiana LLC				
3,780 % fällig am 01.04.2025		25.100	24.340	0,23
Entergy Mississippi LLC				
5,000 % fällig am 01.09.2033		1.000	982	0,01
Enterprise Products Operating LLC				
5,250 % fällig am 16.08.2077		4.739	4.156	0,04
5,375 % fällig am 15.02.2078		5.614	4.658	0,04
8,304 % fällig am 16.08.2077		5.988	5.903	0,06
EPR Properties				
4,500 % fällig am 01.04.2025		4.420	4.189	0,04
4,500 % fällig am 01.06.2027		6.440	5.785	0,06
4,750 % fällig am 15.12.2026		4.425	4.031	0,04
4,950 % fällig am 15.04.2028		1.986	1.776	0,02
Equifax, Inc.				
5,100 % fällig am 01.06.2028		7.900	7.790	0,07
Evergy Missouri West, Inc.				
5,150 % fällig am 15.12.2027		2.000	1.975	0,02
Eversource Energy				
5,125 % fällig am 15.05.2033		300	296	0,00
Exelon Corp.				
4,050 % fällig am 15.04.2030		3.540	3.312	0,03
Expedia Group, Inc.				
3,250 % fällig am 15.02.2030		7.000	6.098	0,06
3,800 % fällig am 15.02.2028		10.805	10.115	0,10
6,250 % fällig am 01.05.2025		983	987	0,01
Fells Point Funding Trust				
3,046 % fällig am 31.01.2027		6.150	5.658	0,05
FirstEnergy Transmission LLC				
4,550 % fällig am 01.04.2049		2.083	1.740	0,02
Fiserv, Inc.				
3,000 % fällig am 01.07.2031	£	800	815	0,01
Flex Intermediate Holdco LLC				
3,363 % fällig am 30.06.2031	$	34.000	27.077	0,26
Ford Foundation				
2,815 % fällig am 01.06.2070		1.600	991	0,01
Ford Motor Credit Co. LLC				
2,330 % fällig am 25.11.2025	€	5.450	5.589	0,05
3,021 % fällig am 06.03.2024		13.290	14.326	0,14
3,250 % fällig am 15.09.2025		1.400	1.469	0,01
4,053 % fällig am 15.11.2023		1.033	1.126	0,01
4,174 % fällig am 01.12.2024		3.187	3.435	0,03
4,535 % fällig am 06.03.2025	£	2.900	3.506	0,03
Freedom Mortgage Corp.				
8,125 % fällig am 15.11.2024	$	4.380	4.344	0,04
8,250 % fällig am 15.04.2025		4.871	4.755	0,05
FS KKR Capital Corp.				
1,650 % fällig am 12.10.2024		12.300	11.443	0,11
2,625 % fällig am 15.01.2027		5.400	4.608	0,04

BESCHREIBUNG		PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
Georgia Power Co.				
3,250 % fällig am 15.03.2051	$	200	$ 141	0,00
4,950 % fällig am 17.05.2033		5.000	4.938	0,05
Global Payments, Inc.				
4,875 % fällig am 17.03.2031	€	8.600	9.351	0,09
5,950 % fällig am 15.08.2052	$	2.200	2.108	0,02
GLP Capital LP				
4,000 % fällig am 15.01.2030		1.500	1.301	0,01
4,000 % fällig am 15.01.2031		4.000	3.462	0,03
5,300 % fällig am 15.01.2029		15.224	14.509	0,14
5,375 % fällig am 15.04.2026		5.600	5.487	0,05
5,750 % fällig am 01.06.2028		14.330	14.033	0,13
Goldman Sachs Group, Inc.				
2,383 % fällig am 21.07.2032		4.100	3.286	0,03
2,600 % fällig am 07.02.2030		5.000	4.263	0,04
4,223 % fällig am 01.05.2029		19.400	18.336	0,17
4,482 % fällig am 23.08.2028		17.300	16.737	0,16
6,491 % fällig am 15.05.2026		14.800	14.983	0,14
7,250 % fällig am 10.04.2028	£	3.817	4.973	0,05
Goodman U.S. Finance Four LLC				
4,500 % fällig am 15.10.2037	$	7.182	5.999	0,06
Goodman U.S. Finance Three LLC				
3,700 % fällig am 15.03.2028		12.875	11.685	0,11
Guardian Life Global Funding				
1,100 % fällig am 23.06.2025		3.000	2.731	0,03
Gulfstream Natural Gas System LLC				
4,600 % fällig am 15.09.2025		4.560	4.385	0,04
Haleon U.S. Capital LLC				
3,625 % fällig am 24.03.2032		500	448	0,00
Hanover Insurance Group, Inc.				
4,500 % fällig am 15.04.2026		740	717	0,01
HCA, Inc.				
3,500 % fällig am 15.07.2051		3.800	2.633	0,03
4,125 % fällig am 15.06.2029		3.100	2.870	0,03
4,500 % fällig am 15.02.2027		3.800	3.668	0,03
5,500 % fällig am 01.06.2033		22.550	22.524	0,21
Highwoods Realty LP				
2,600 % fällig am 01.02.2031		6.800	4.991	0,05
4,200 % fällig am 15.04.2029		2.500	2.109	0,02
Host Hotels & Resorts LP				
2,900 % fällig am 15.12.2031		2.500	1.969	0,02
3,375 % fällig am 15.12.2029		4.700	4.021	0,04
3,500 % fällig am 15.09.2030		2.600	2.206	0,02
3,875 % fällig am 01.04.2024		8.200	8.070	0,08
4,000 % fällig am 15.06.2025		1.625	1.563	0,01
Howard Midstream Energy Partners LLC				
8,875 % fällig am 15.07.2028 (b)		1.000	1.006	0,01
Hudson Pacific Properties LP				
3,250 % fällig am 15.01.2030		2.325	1.474	0,01
3,950 % fällig am 01.11.2027		3.000	2.184	0,02
5,950 % fällig am 15.02.2028		100	80	0,00
Humana, Inc.				
5,875 % fällig am 01.03.2033		6.000	6.238	0,06
Hyundai Capital America				
0,875 % fällig am 14.06.2024		12.010	11.457	0,11
1,500 % fällig am 15.06.2026		10.200	9.038	0,09
Infor, Inc.				
1,450 % fällig am 15.07.2023		7.100	7.088	0,07
1,750 % fällig am 15.07.2025		4.700	4.293	0,04
Integris Baptist Medical Center, Inc.				
3,875 % fällig am 15.08.2050		8.300	6.274	0,06
Intercontinental Exchange, Inc.				
3,000 % fällig am 15.09.2060		9.450	6.194	0,06
International Flavors & Fragrances, Inc.				
1,832 % fällig am 15.10.2027		5.000	4.221	0,04
Invitation Homes Operating Partnership LP				
4,150 % fällig am 15.04.2032		1.500	1.345	0,01
Ipalco Enterprises, Inc.				
3,700 % fällig am 01.09.2024		2.858	2.764	0,03
4,250 % fällig am 01.05.2030		200	181	0,00
Jackson National Life Global Funding				
2,650 % fällig am 21.06.2024		600	581	0,01
Jersey Central Power & Light Co.				
4,300 % fällig am 15.01.2026		880	852	0,01
4,700 % fällig am 01.04.2024		3.800	3.761	0,04
JetBlue Pass-Through Trust				
4,000 % fällig am 15.05.2034		920	840	0,01

BESCHREIBUNG		PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
JPMorgan Chase & Co.				
2,069 % fällig am 01.06.2029	$	6.600	$ 5.665	0,05
2,301 % fällig am 15.10.2025		32.500	30.982	0,30
2,545 % fällig am 08.11.2032		10.000	8.197	0,08
2,580 % fällig am 22.04.2032		16.700	13.877	0,13
2,739 % fällig am 15.10.2030		35.800	30.872	0,29
3,702 % fällig am 06.05.2030		9.300	8.531	0,08
3,782 % fällig am 01.02.2028		3.569	3.397	0,03
3,797 % fällig am 23.07.2024		7.500	7.491	0,07
4,565 % fällig am 14.06.2030		10.000	9.618	0,09
5,350 % fällig am 01.06.2034		5.000	5.042	0,05
6,163 % fällig am 23.07.2024		14.100	14.109	0,13
Kentucky Utilities Co.				
5,450 % fällig am 15.04.2033		4.000	4.078	0,04
Kenvue, Inc.				
4,900 % fällig am 22.03.2033		1.200	1.215	0,01
5,000 % fällig am 22.03.2030		400	404	0,00
5,100 % fällig am 22.03.2043		6.700	6.816	0,07
Kilroy Realty LP				
2,500 % fällig am 15.11.2032		1.100	765	0,01
Kinder Morgan, Inc.				
7,420 % fällig am 15.02.2037		3.500	3.795	0,04
8,050 % fällig am 15.10.2030		36	40	0,00
KKR Financial Holdings LLC				
5,400 % fällig am 23.05.2033		10.400	9.692	0,09
KKR Group Finance Co. LLC				
3,625 % fällig am 25.02.2050		1.300	896	0,01
Kraft Heinz Foods Co.				
4,125 % fällig am 01.07.2027	£	6.150	7.237	0,07
4,375 % fällig am 01.06.2046	$	25.000	21.264	0,20
Las Vegas Sands Corp.				
3,200 % fällig am 08.08.2024		51.200	49.623	0,47
3,500 % fällig am 18.08.2026		3.900	3.635	0,03
Lazard Group LLC				
4,375 % fällig am 11.03.2029		4.968	4.616	0,04
Lehman Brothers Holdings, Inc.				
0,000 % fällig am 23.12.2010 ^		900	2	0,00
5,259 % fällig am 12.06.2013 ^	€	2.807	16	0,00
6,875 % fällig am 02.05.2018 ^	$	3.000	7	0,00
Leidos, Inc.				
2,300 % fällig am 15.02.2031		2.034	1.604	0,02
Level 3 Financing, Inc.				
3,625 % fällig am 15.01.2029		700	421	0,00
3,875 % fällig am 15.11.2029		4.000	3.187	0,03
Liberty Mutual Group, Inc.				
3,625 % fällig am 23.05.2059	€	2.900	3.013	0,03
4,569 % fällig am 01.02.2029	$	800	755	0,01
Marriott International, Inc.				
3,500 % fällig am 15.10.2032		11.240	9.717	0,09
4,150 % fällig am 01.12.2023		3.900	3.881	0,04
Marvell Technology, Inc.				
2,450 % fällig am 15.04.2028		15.000	13.107	0,12
MassMutual Global Funding				
3,400 % fällig am 08.03.2026		3.700	3.519	0,03
Merck & Co., Inc.				
5,150 % fällig am 17.05.2063		2.100	2.147	0,02
Meta Platforms, Inc.				
5,600 % fällig am 15.05.2053		12.800	13.155	0,13
MetLife Capital Trust				
7,875 % fällig am 15.12.2067		3.282	3.444	0,03
MetLife, Inc.				
5,875 % fällig am 15.03.2028 (g)		7.400	6.893	0,07
Metropolitan Edison Co.				
4,000 % fällig am 15.04.2025		6.300	6.037	0,06
Mid-America Apartments LP				
1,100 % fällig am 15.09.2026		2.600	2.270	0,02
3,600 % fällig am 01.06.2027		1.925	1.820	0,02
3,950 % fällig am 15.03.2029		6.857	6.464	0,06
Mid-Atlantic Interstate Transmission LLC				
4,100 % fällig am 15.05.2028		7.140	6.757	0,06
Midwest Connector Capital Co. LLC				
3,900 % fällig am 01.04.2024		30.282	29.655	0,28
Mileage Plus Holdings LLC				
6,500 % fällig am 20.06.2027		6.320	6.341	0,06
Mississippi Power Co.				
3,950 % fällig am 30.03.2028		100	94	0,00
4,250 % fällig am 15.03.2042		2.600	2.169	0,02

BESCHREIBUNG		PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
Monongahela Power Co.				
5,400 % fällig am 15.12.2043	$	150	$ 146	0,00
Morgan Stanley				
0,000 % fällig am 02.04.2032 (j)		46.900	29.310	0,28
5,250 % fällig am 21.04.2034		2.700	2.667	0,03
MSCI, Inc.				
3,250 % fällig am 15.08.2033		700	564	0,01
3,625 % fällig am 01.09.2030		2.500	2.158	0,02
4,000 % fällig am 15.11.2029		5.350	4.847	0,05
Nasdaq, Inc.				
5,350 % fällig am 28.06.2028		400	401	0,00
National Fuel Gas Co.				
2,950 % fällig am 01.03.2031		3.700	2.963	0,03
National Health Investors, Inc.				
3,000 % fällig am 01.02.2031		1.800	1.384	0,01
Nationwide Financial Services, Inc.				
3,900 % fällig am 30.11.2049		8.800	6.436	0,06
Nationwide Mutual Insurance Co.				
9,375 % fällig am 15.08.2039		200	258	0,00
Netflix, Inc.				
3,625 % fällig am 15.06.2030	€	29.473	30.654	0,29
3,875 % fällig am 15.11.2029		17.950	19.123	0,18
Neuberger Berman Group LLC				
4,500 % fällig am 15.03.2027	$	12.200	11.514	0,11
NextEra Energy Capital Holdings, Inc.				
1,900 % fällig am 15.06.2028		5.000	4.290	0,04
4,800 % fällig am 01.12.2077		140	123	0,00
5,250 % fällig am 28.02.2053		5.000	4.820	0,05
5,481 % fällig am 03.11.2023		3.930	3.930	0,04
5,650 % fällig am 01.05.2079		500	465	0,00
NGPL PipeCo LLC				
4,875 % fällig am 15.08.2027		8.855	8.397	0,08
Nissan Motor Acceptance Co. LLC				
1,850 % fällig am 16.09.2026		15.000	12.734	0,12
NVR, Inc.				
3,000 % fällig am 15.05.2030		21.840	18.936	0,18
Oaktree Specialty Lending Corp.				
3,500 % fällig am 25.02.2025		2.000	1.895	0,02
Occidental Petroleum Corp.				
6,200 % fällig am 15.03.2040		3.750	3.701	0,04
6,600 % fällig am 15.03.2046		2.000	2.062	0,02
6,625 % fällig am 01.09.2030		1.000	1.040	0,01
8,875 % fällig am 15.07.2030		4.850	5.579	0,05
Oklahoma Gas & Electric Co.				
5,400 % fällig am 15.01.2033		3.269	3.324	0,03
Omega Healthcare Investors, Inc.				
5,250 % fällig am 15.01.2026		4.200	4.047	0,04
OneMain Finance Corp.				
6,875 % fällig am 15.03.2025		5.400	5.352	0,05
ONEOK, Inc.				
4,350 % fällig am 15.03.2029		21.030	19.568	0,19
6,100 % fällig am 15.11.2032		4.300	4.376	0,04
Oracle Corp.				
3,600 % fällig am 01.04.2050		500	358	0,00
3,850 % fällig am 01.04.2060		1.800	1.270	0,01
4,100 % fällig am 25.03.2061 (j)		6.600	4.877	0,05
4,900 % fällig am 06.02.2033		1.800	1.748	0,02
6,250 % fällig am 09.11.2032 (j)		14.500	15.398	0,15
Organon & Co.				
2,875 % fällig am 30.04.2028	€	2.300	2.184	0,02
Ovintiv, Inc.				
6,250 % fällig am 15.07.2033	$	3.000	2.961	0,03
Pacific Gas & Electric Co.				
2,500 % fällig am 01.02.2031		500	392	0,00
2,950 % fällig am 01.03.2026 ^		6.700	6.141	0,06
3,000 % fällig am 15.06.2028		16.330	14.091	0,13
3,150 % fällig am 01.01.2026		7.209	6.693	0,06
3,300 % fällig am 15.03.2027 ^		11.935	10.842	0,10
3,300 % fällig am 01.12.2027 ^		15.869	13.926	0,13
3,400 % fällig am 15.08.2024 ^		9.676	9.366	0,09
3,450 % fällig am 01.07.2025		5.877	5.552	0,05
3,500 % fällig am 15.06.2025 ^		13.400	12.692	0,12
3,750 % fällig am 15.08.2042 ^		3.300	2.287	0,02
3,850 % fällig am 15.11.2023 ^		5.177	5.132	0,05
4,000 % fällig am 01.12.2046 ^		100	67	0,00
4,200 % fällig am 01.06.2041		2.173	1.622	0,02
4,450 % fällig am 15.04.2042 ^		8.543	6.479	0,06
4,500 % fällig am 15.12.2041 ^		3.400	2.509	0,02

BESCHREIBUNG		PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
4,650 % fällig am 01.08.2028	$	1.600	$ 1.481	0,01
4,750 % fällig am 15.02.2044 ^		1.889	1.468	0,01
5,900 % fällig am 15.06.2032		1.900	1.830	0,02
6,700 % fällig am 01.04.2053		7.000	6.879	0,07
Pacific Life Global Funding				
1,200 % fällig am 24.06.2025		8.100	7.390	0,07
PacifiCorp				
6,250 % fällig am 15.10.2037		3.600	3.601	0,03
Pactiv Evergreen Group Issuer LLC				
4,375 % fällig am 15.10.2028		1.700	1.474	0,01
PECO Energy Co.				
3,000 % fällig am 15.09.2049		200	140	0,00
Pennsylvania Electric Co.				
3,600 % fällig am 01.06.2029		6.770	6.153	0,06
4,150 % fällig am 15.04.2025		2.205	2.123	0,02
6,150 % fällig am 01.10.2038		4.415	4.402	0,04
Penske Truck Leasing Co. LP				
3,350 % fällig am 01.11.2029		17.110	14.620	0,14
Philip Morris International, Inc.				
5,625 % fällig am 17.11.2029		6.800	6.934	0,07
Physicians Realty LP				
3,950 % fällig am 15.01.2028		11.870	10.847	0,10
4,300 % fällig am 15.03.2027		7.400	6.973	0,07
Piedmont Natural Gas Co., Inc.				
5,400 % fällig am 15.06.2033		5.000	4.992	0,05
Pioneer Natural Resources Co.				
7,200 % fällig am 15.01.2028		2.500	2.649	0,03
Plains All American Pipeline LP				
6,700 % fällig am 15.05.2036		300	296	0,00
Principal Life Global Funding				
3,000 % fällig am 18.04.2026		5.700	5.286	0,05
Progress Energy, Inc.				
7,750 % fällig am 01.03.2031		750	851	0,01
Prologis Euro Finance LLC				
3,875 % fällig am 31.01.2030	€	2.100	2.224	0,02
4,250 % fällig am 31.01.2043		5.100	5.157	0,05
Protective Life Corp.				
3,400 % fällig am 15.01.2030	$	21.300	18.534	0,18
Provident Funding Associates LP				
6,375 % fällig am 15.06.2025		4.100	3.623	0,03
Realty Income Corp.				
2,200 % fällig am 15.06.2028		5.000	4.336	0,04
4,875 % fällig am 01.06.2026		3.471	3.435	0,03
4,875 % fällig am 06.07.2030 (b)	€	600	652	0,01
Regency Centers LP				
2,950 % fällig am 15.09.2029	$	1.200	1.030	0,01
Reliance Standard Life Global Funding				
2,750 % fällig am 21.01.2027		6.100	5.457	0,05
Rio Oil Finance Trust				
8,200 % fällig am 06.04.2028		3.671	3.694	0,04
9,250 % fällig am 06.07.2024		1.765	1.782	0,02
9,750 % fällig am 06.01.2027		156	161	0,00
Rockies Express Pipeline LLC				
4,800 % fällig am 15.05.2030		6.600	5.774	0,06
S&P Global, Inc.				
4,250 % fällig am 01.05.2029		13.610	13.236	0,13
4,750 % fällig am 01.08.2028		2.600	2.586	0,02
Sabine Pass Liquefaction LLC				
4,200 % fällig am 15.03.2028		5.700	5.406	0,05
5,000 % fällig am 15.03.2027		7.300	7.190	0,07
5,750 % fällig am 15.05.2024		2.548	2.544	0,02
Sabra Health Care LP				
3,200 % fällig am 01.12.2031		4.050	3.026	0,03
Sammons Financial Group, Inc.				
4,450 % fällig am 12.05.2027		700	646	0,01
San Diego Gas & Electric Co.				
3,750 % fällig am 01.06.2047		100	78	0,00
4,100 % fällig am 15.06.2049		3.400	2.798	0,03
5,350 % fällig am 01.04.2053		3.075	3.053	0,03
Santander Holdings USA, Inc.				
2,490 % fällig am 06.01.2028		4.600	3.977	0,04
3,244 % fällig am 05.10.2026		2.500	2.253	0,02
3,500 % fällig am 07.06.2024		9.500	9.228	0,09
4,500 % fällig am 17.07.2025		4.000	3.885	0,04
SBA Tower Trust				
1,884 % fällig am 15.07.2050		25.500	22.928	0,22
2,836 % fällig am 15.01.2050		7.009	6.658	0,06

BESCHREIBUNG		PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
SCE Recovery Funding LLC				
5,112 % fällig am 14.12.2049	$	3.100	$ 3.067	0,03
Sempra Energy				
4,125 % fällig am 01.04.2052		4.100	3.322	0,03
5,500 % fällig am 01.08.2033		11.200	11.134	0,11
SLM Corp.				
4,200 % fällig am 29.10.2025		2.200	2.046	0,02
Southern California Edison Co.				
2,250 % fällig am 01.06.2030		1.110	929	0,01
2,500 % fällig am 01.06.2031		4.631	3.855	0,04
2,750 % fällig am 01.02.2032		6.400	5.358	0,05
2,950 % fällig am 01.02.2051		6.400	4.200	0,04
3,450 % fällig am 01.02.2052		5.800	4.159	0,04
3,650 % fällig am 01.06.2051		4.300	3.198	0,03
3,900 % fällig am 01.12.2041		450	353	0,00
4,000 % fällig am 01.04.2047		11.644	9.262	0,09
4,125 % fällig am 01.03.2048		3.755	3.052	0,03
5,625 % fällig am 01.02.2036		2.053	2.036	0,02
5,950 % fällig am 01.02.2038		1.490	1.534	0,01
6,650 % fällig am 01.04.2029		10.800	11.191	0,11
Southern California Gas Co.				
5,200 % fällig am 01.06.2033		10.000	9.873	0,09
Southern Co.				
1,875 % fällig am 15.09.2081	€	2.800	2.398	0,02
5,200 % fällig am 15.06.2033	$	1.000	993	0,01
Southern Co. Gas Capital Corp.				
1,750 % fällig am 15.01.2031		11.390	8.957	0,09
3,250 % fällig am 15.06.2026		1.100	1.037	0,01
4,400 % fällig am 30.05.2047		600	499	0,00
5,875 % fällig am 15.03.2041		1.920	1.936	0,02
Southern Power Co.				
5,250 % fällig am 15.07.2043		2.800	2.582	0,02
Southwest Airlines Co.				
5,125 % fällig am 15.06.2027		7.600	7.549	0,07
Spirit AeroSystems, Inc.				
3,850 % fällig am 15.06.2026		1.200	1.116	0,01
Spirit Airlines Pass-Through Trust				
4,100 % fällig am 01.10.2029		2.425	2.197	0,02
Spirit Realty LP				
3,200 % fällig am 15.01.2027		4.800	4.325	0,04
3,200 % fällig am 15.02.2031		2.245	1.836	0,02
4,000 % fällig am 15.07.2029		1.000	881	0,01
4,450 % fällig am 15.09.2026		6.100	5.751	0,05
Sprint LLC				
7,875 % fällig am 15.09.2023		4.300	4.314	0,04
Sprint Spectrum Co. LLC				
4,738 % fällig am 20.09.2029		5.119	5.054	0,05
5,152 % fällig am 20.09.2029		3.800	3.761	0,04
Standard Industries, Inc.				
2,250 % fällig am 21.11.2026	€	14.450	14.041	0,13
STORE Capital Corp.				
2,750 % fällig am 18.11.2030	$	2.000	1.448	0,01
4,500 % fällig am 15.03.2028		800	700	0,01
Stryker Corp.				
1,950 % fällig am 15.06.2030		9.650	8.066	0,08
Sun Communities Operating LP				
4,200 % fällig am 15.04.2032		3.400	2.973	0,03
Synchrony Bank				
5,625 % fällig am 23.08.2027		7.550	7.091	0,07
Synchrony Financial				
3,950 % fällig am 01.12.2027		5.200	4.536	0,04
System Energy Resources, Inc.				
2,140 % fällig am 09.12.2025		17.300	15.704	0,15
T-Mobile USA, Inc.				
2,050 % fällig am 15.02.2028		13.940	12.095	0,12
2,250 % fällig am 15.11.2031		16.100	12.890	0,12
2,550 % fällig am 15.02.2031		8.000	6.652	0,06
3,300 % fällig am 15.02.2051		2.200	1.545	0,01
3,875 % fällig am 15.04.2030		13.200	12.169	0,12
4,800 % fällig am 15.07.2028		8.400	8.230	0,08
5,650 % fällig am 15.01.2053		1.900	1.931	0,02
Targa Resources Corp.				
6,125 % fällig am 15.03.2033		3.500	3.578	0,03
TD SYNNEX Corp.				
1,750 % fällig am 09.08.2026		5.950	5.190	0,05
2,375 % fällig am 09.08.2028		10.000	8.202	0,08
Teachers Insurance & Annuity Association of America				
4,375 % fällig am 15.09.2054		18.200	17.577	0,17

BESCHREIBUNG		PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
Time Warner Cable Enterprises LLC				
8,375 % fällig am 15.07.2033	$	400	$ 440	0,00
Times Square Hotel Trust				
8,528 % fällig am 01.08.2026		4.164	4.119	0,04
Trans-Allegheny Interstate Line Co.				
3,850 % fällig am 01.06.2025		1.157	1.113	0,01
Transcontinental Gas Pipe Line Co. LLC				
3,250 % fällig am 15.05.2030		6.000	5.339	0,05
Trimble, Inc.				
6,100 % fällig am 15.03.2033		1.300	1.318	0,01
Truist Financial Corp.				
4,873 % fällig am 26.01.2029		5.000	4.809	0,05
5,122 % fällig am 26.01.2034		1.700	1.612	0,02
U.S. Airways Pass-Through Trust				
5,900 % fällig am 01.04.2026		987	979	0,01
U.S. Bancorp				
4,653 % fällig am 01.02.2029		3.500	3.347	0,03
UDR, Inc.				
3,000 % fällig am 15.08.2031		7.100	6.013	0,06
United Airlines Pass-Through Trust				
2,700 % fällig am 01.11.2033		6.602	5.547	0,05
2,875 % fällig am 07.04.2030		496	438	0,00
3,450 % fällig am 01.06.2029		662	607	0,01
3,450 % fällig am 07.01.2030		2.200	1.905	0,02
3,500 % fällig am 01.09.2031		15.443	13.954	0,13
3,700 % fällig am 01.09.2031		5.137	4.459	0,04
4,000 % fällig am 11.10.2027		1.764	1.661	0,02
4,150 % fällig am 11.10.2025		1.676	1.648	0,02
4,150 % fällig am 25.02.2033		9.834	9.034	0,09
4,300 % fällig am 15.02.2027		1.677	1.614	0,02
4,550 % fällig am 25.02.2033		976	871	0,01
5,800 % fällig am 15.07.2037		6.500	6.616	0,06
5,875 % fällig am 15.04.2029		6.097	6.052	0,06
UnitedHealth Group, Inc.				
5,875 % fällig am 15.02.2053		25.000	27.795	0,26
6,050 % fällig am 15.02.2063		10.000	11.318	0,11
Venture Global Calcasieu Pass LLC				
3,875 % fällig am 01.11.2033		7.800	6.398	0,06
6,250 % fällig am 15.01.2030		39.500	39.219	0,37
Venture Global LNG, Inc.				
8,125 % fällig am 01.06.2028		14.700	14.946	0,14
8,375 % fällig am 01.06.2031		14.500	14.638	0,14
Verizon Communications, Inc.				
2,100 % fällig am 22.03.2028		1.400	1.231	0,01
2,355 % fällig am 15.03.2032		736	592	0,01
5,882 % fällig am 20.03.2026		1.400	1.402	0,01
6,421 % fällig am 15.05.2025		6.800	6.858	0,07
VICI Properties LP				
3,875 % fällig am 15.02.2029		7.400	6.501	0,06
4,250 % fällig am 01.12.2026		5.200	4.869	0,05
4,500 % fällig am 15.01.2028		4.200	3.863	0,04
4,625 % fällig am 01.12.2029		2.825	2.567	0,02
5,750 % fällig am 01.02.2027		2.000	1.959	0,02
Virginia Electric and Power Co.				
5,000 % fällig am 01.04.2033		5.000	4.945	0,05
Vistra Operations Co. LLC				
3,550 % fällig am 15.07.2024		9.500	9.178	0,09
3,700 % fällig am 30.01.2027		8.000	7.332	0,07
VMware, Inc.				
1,000 % fällig am 15.08.2024		5.000	4.736	0,05
3,900 % fällig am 21.08.2027		7.900	7.495	0,07
4,700 % fällig am 15.05.2030		19.415	18.541	0,18
Volkswagen Group of America Finance LLC				
6,040 % fällig am 07.06.2024		1.500	1.504	0,01
Walt Disney Co.				
2,200 % fällig am 13.01.2028		5.959	5.389	0,05
Warnermedia Holdings, Inc.				
3,755 % fällig am 15.03.2027		1.500	1.400	0,01
4,279 % fällig am 15.03.2032		5.950	5.280	0,05
5,141 % fällig am 15.03.2052		9.090	7.408	0,07
WEA Finance LLC				
3,750 % fällig am 17.09.2024		8.000	7.558	0,07
WEC Energy Group, Inc.				
4,750 % fällig am 09.01.2026		7.300	7.193	0,07
Wells Fargo & Co.				
2,393 % fällig am 02.06.2028		11.500	10.256	0,10
3,196 % fällig am 17.06.2027		5.800	5.450	0,05
3,584 % fällig am 22.05.2028		7.000	6.524	0,06

BESCHREIBUNG		PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
4,897 % fällig am 25.07.2033	$	15.000	$ 14.396	0,14
5,389 % fällig am 24.04.2034		1.600	1.591	0,02
West Virginia United Health System Obligated Group				
3,129 % fällig am 01.06.2050		1.500	1.005	0,01
Westinghouse Air Brake Technologies Corp.				
4,400 % fällig am 15.03.2024		8.860	8.743	0,08
4,950 % fällig am 15.09.2028		8.150	7.857	0,07
Weyerhaeuser Co.				
4,000 % fällig am 15.11.2029		1.820	1.680	0,02
4,000 % fällig am 15.04.2030		1.114	1.026	0,01
4,750 % fällig am 15.05.2026		12.100	11.892	0,11
6,875 % fällig am 15.12.2033		649	707	0,01
7,350 % fällig am 01.07.2026		12.350	12.794	0,12
7,375 % fällig am 15.03.2032		2.889	3.226	0,03
Xcel Energy, Inc.				
4,600 % fällig am 01.06.2032		18.000	17.009	0,16
Yellowstone Energy LP				
5,750 % fällig am 31.12.2026		4.115	4.108	0,04
Zimmer Biomet Holdings, Inc.				
1,164 % fällig am 15.11.2027	€	4.320	4.183	0,04
2,425 % fällig am 13.12.2026		4.500	4.653	0,04
			3.376.886	32,18

KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG

Avolon TLB Borrower (U.S.) LLC				
7,396 % fällig am 01.12.2027	$	10.898	10.897	0,10
Charter Communications Operating LLC				
6,795 % - 6,834 % fällig am 01.02.2027		4.635	4.613	0,05
IQVIA, Inc.				
5,598 % fällig am 07.03.2024	€	1.000	1.091	0,01
SkyMiles IP Ltd.				
8,798 % fällig am 20.10.2027	$	10.980	11.419	0,11
			28.020	0,27

KOMMUNALANLEIHEN UND WECHSEL

Illinois State General Obligation Bonds, (BABs), Series 2010				
6,725 % fällig am 01.04.2035		92	97	0,00
7,350 % fällig am 01.07.2035		464	501	0,01
Municipal Electric Authority of Georgia Revenue Bonds, (BABs), Series 2010				
6,637 % fällig am 01.04.2057		191	219	0,00
New York City Transitional Finance Authority Future Tax Secured Revenue Bonds, Series 2010				
5,267 % fällig am 01.05.2027		2.200	2.213	0,02
State Board of Administration Finance Corp., Florida Revenue Notes, Series 2020				
1,258 % fällig am 01.07.2025		25.400	23.460	0,22
1,705 % fällig am 01.07.2027		17.100	15.148	0,15
			41.638	0,40

NON-AGENCY-MBS

American Home Mortgage Assets Trust				
4,916 % fällig am 25.10.2046		6.451	4.532	0,04
Banc of America Funding Trust				
4,496 % fällig am 20.09.2034		1	1	0,00
Barclays Commercial Mortgage Securities Trust				
6,193 % fällig am 15.10.2037		1.378	1.346	0,01
Bear Stearns Adjustable Rate Mortgage Trust				
3,777 % fällig am 25.01.2035		311	289	0,00
4,146 % fällig am 25.08.2035 ^		30	27	0,00
4,439 % fällig am 25.02.2034		4	4	0,00
4,609 % fällig am 25.11.2034		110	97	0,00
Bear Stearns ALT-A Trust				
3,731 % fällig am 25.11.2036 ^		414	196	0,00
5,470 % fällig am 25.06.2046 ^		2.141	1.848	0,02
BWAY Mortgage Trust				
2,809 % fällig am 10.03.2033		223	213	0,00
Chase Mortgage Finance Trust				
5,140 % fällig am 25.02.2037		7	7	0,00
Chevy Chase Funding LLC Mortgage-Backed Certificates				
5,380 % fällig am 25.10.2035		62	58	0,00
5,430 % fällig am 25.01.2035		80	76	0,00
Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.				
6,780 % fällig am 25.09.2035		10	10	0,00
Commercial Mortgage Trust				
3,178 % fällig am 10.02.2035		10.100	9.384	0,09
Countrywide Alternative Loan Trust				
5,326 % fällig am 25.08.2035 ^	$	1.641	$ 1.308	0,01
5,367 % fällig am 20.07.2046 ^		4.146	3.334	0,03
5,710 % fällig am 25.02.2037		37	31	0,00
5,750 % fällig am 25.04.2047 ^		572	329	0,00
5,770 % fällig am 25.08.2035 ^		450	401	0,01
5,850 % fällig am 25.12.2035 ^		1.255	1.044	0,01
Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust				
3,810 % fällig am 25.11.2034		18	16	0,00
3,842 % fällig am 25.01.2036 ^		171	155	0,00
5,500 % fällig am 25.10.2034		397	383	0,01
5,500 % fällig am 25.07.2035		38	20	0,00
5,500 % fällig am 25.12.2035		151	114	0,00
5,500 % fällig am 25.12.2035 ^		79	59	0,00
5,610 % fällig am 25.05.2035		4	3	0,00
5,910 % fällig am 20.02.2036 ^		17	15	0,00
6,000 % fällig am 25.11.2037 ^		27	15	0,00
Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp.				
4,311 % fällig am 25.06.2033		4	3	0,00
Credit Suisse First Boston Mortgage-Backed Pass-Through Certificates				
4,260 % fällig am 25.07.2033		3	3	0,00
6,500 % fällig am 25.12.2033		13	13	0,00
Credit Suisse Mortgage Capital Certificates				
3,824 % fällig am 26.06.2037		4.653	4.368	0,04
Credit Suisse Mortgage Capital Trust				
3,558 % fällig am 27.05.2037		3.702	2.489	0,03
Deutsche ALT-A Securities Mortgage Loan Trust				
5,290 % fällig am 25.07.2047		425	388	0,01
Freddie Mac				
5,992 % fällig am 25.11.2055		5.909	3.409	0,03
GSC Capital Corp. Mortgage Trust				
5,510 % fällig am 25.05.2036 ^		395	367	0,00
GSMPS Mortgage Loan Trust				
5,500 % fällig am 25.01.2036		1.904	1.552	0,02
GSR Mortgage Loan Trust				
4,662 % fällig am 25.09.2035		0	0	0,00
6,970 % fällig am 25.04.2032		102	84	0,00
HarborView Mortgage Loan Trust				
4,553 % fällig am 19.04.2034		6	5	0,00
5,347 % fällig am 19.08.2037		4.356	3.818	0,04
5,567 % fällig am 19.12.2036		3.128	2.614	0,03
5,837 % fällig am 20.06.2035		1.505	1.372	0,01
HomeBanc Mortgage Trust				
5,650 % fällig am 25.03.2035		262	213	0,00
Impac CMB Trust				
5,850 % fällig am 25.03.2035		148	136	0,00
IndyMac Mortgage Loan Trust				
3,438 % fällig am 25.03.2036		726	514	0,01
JPMorgan Alternative Loan Trust				
5,843 % fällig am 26.05.2037		214	162	0,00
JPMorgan Mortgage Trust				
4,099 % fällig am 25.07.2035		18	16	0,00
Lehman Mortgage Trust				
5,750 % fällig am 25.02.2037 ^		1.439	1.015	0,01
MASTR Adjustable Rate Mortgages Trust				
4,560 % fällig am 21.11.2034		6	5	0,00
MASTR Alternative Loan Trust				
5,500 % fällig am 25.02.2034		14	13	0,00
Merrill Lynch Mortgage Investors Trust				
4,159 % fällig am 25.02.2035		18	16	0,00
4,459 % fällig am 25.05.2036		261	236	0,00
4,969 % fällig am 25.05.2033		2	2	0,00
5,810 % fällig am 25.06.2028		0	0	0,00
6,000 % fällig am 25.04.2036 ^		36	18	0,00
6,184 % fällig am 25.01.2029		92	87	0,00
MortgageIT Trust				
5,890 % fällig am 25.12.2034		89	86	0,00
NAAC Reperforming Loan REMIC Trust Certificates				
5,600 % fällig am 25.02.2035 ^		228	194	0,00
Residential Accredit Loans, Inc. Trust				
5,476 % fällig am 25.08.2035		170	140	0,00
5,570 % fällig am 25.04.2046		5.463	1.614	0,02
6,000 % fällig am 25.02.2037 ^		2.592	2.088	0,02
Residential Asset Securitization Trust				
6,500 % fällig am 25.04.2037 ^		2.119	613	0,01
Sequoia Mortgage Trust				
5,557 % fällig am 20.05.2035		121	105	0,00
5,931 % fällig am 20.05.2034		436	405	0,01
Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust				
4,702 % fällig am 25.04.2035	$	193	$ 181	0,00
Structured Asset Mortgage Investments Trust				
5,436 % fällig am 25.03.2046		109	98	0,00
5,530 % fällig am 25.07.2046 ^		170	122	0,00
5,570 % fällig am 25.04.2036		102	90	0,00
5,570 % fällig am 25.05.2036		9	6	0,00
5,646 % fällig am 19.07.2035		1	1	0,00
5,710 % fällig am 25.02.2036 ^		16	13	0,00
Structured Asset Securities Corp. Mortgage Pass-Through Certificates				
5,785 % fällig am 25.07.2033		163	152	0,00
6,639 % fällig am 25.06.2033		2	1	0,00
Thornburg Mortgage Securities Trust				
3,018 % fällig am 25.09.2037		213	207	0,00
Towd Point Mortgage Trust				
2,750 % fällig am 25.06.2057		4.220	3.981	0,04
WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust				
2,588 % fällig am 25.11.2041		162	145	0,00
4,079 % fällig am 25.03.2035		52	49	0,00
4,976 % fällig am 25.08.2046		6	6	0,00
5,520 % fällig am 25.05.2034		1.580	1.403	0,01
5,690 % fällig am 25.12.2045		4	4	0,00
5,770 % fällig am 25.01.2045		13	12	0,00
Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates Trust				
4,816 % fällig am 25.11.2046 ^		2.031	1.704	0,02
5,530 % fällig am 25.06.2037		3.133	2.865	0,03
Washington Mutual MSC Mortgage Pass-Through Certificates Trust				
4,324 % fällig am 25.06.2033		70	66	0,00
Wells Fargo Alternative Loan Trust				
5,134 % fällig am 25.07.2037 ^		141	127	0,00
5,690 % fällig am 25.03.2037 ^		1.162	909	0,01
Wells Fargo Mortgage-Backed Securities Trust				
4,890 % fällig am 25.08.2036 ^		284	266	0,00
			65.886	0,63

US-REGIERUNGSBEHÖRDEN

Fannie Mae				
3,585 % fällig am 01.12.2034		11	11	0,00
3,916 % fällig am 01.01.2037		0	0	0,00
4,003 % fällig am 01.02.2037		1	1	0,00
4,035 % fällig am 01.10.2037		0	0	0,00
4,042 % fällig am 01.10.2036		0	0	0,00
4,073 % fällig am 01.03.2037		24	23	0,00
4,346 % fällig am 01.09.2037		1	1	0,00
4,375 % fällig am 01.03.2037		0	0	0,00
4,451 % fällig am 01.09.2037		2	2	0,00
4,525 % fällig am 01.04.2037		0	0	0,00
4,943 % fällig am 01.06.2043		8	7	0,00
4,944 % fällig am 01.10.2044		5	4	0,00
5,036 % fällig am 25.07.2037		2	2	0,00
5,500 % fällig am 25.05.2036 - 25.09.2042		295	297	0,00
6,050 % fällig am 25.04.2032		0	0	0,00
6,625 % fällig am 15.11.2030		17.025	19.765	0,19
Freddie Mac				
1,147 % fällig am 25.08.2029 (a)		2.903	136	0,00
3,943 % fällig am 01.01.2037		0	0	0,00
4,008 % fällig am 01.10.2038		0	0	0,00
4,221 % fällig am 01.06.2037		0	0	0,00
4,311 % fällig am 01.03.2037		2	2	0,00
4,315 % fällig am 01.03.2036		1	1	0,00
4,410 % fällig am 01.04.2037		0	0	0,00
4,500 % fällig am 01.01.2040		29	29	0,00
4,660 % fällig am 01.03.2036		0	0	0,00
5,176 % fällig am 25.02.2045		17	16	0,00
Ginnie Mae, TBA				
4,000 % fällig am 01.08.2053		3.000	2.841	0,03
Small Business Administration				
4,720 % fällig am 01.02.2024		7	7	0,00
5,240 % fällig am 01.08.2023		4	4	0,00
Uniform Mortgage-Backed Security				
3,000 % fällig am 01.06.2042 - 01.10.2046		35.007	31.626	0,30
3,500 % fällig am 01.10.2045		3.322	3.091	0,03
4,000 % fällig am 01.05.2030 - 01.01.2041		183	179	0,00
Uniform Mortgage-Backed Security, TBA				
3,500 % fällig am 01.08.2053		67.400	61.489	0,59

BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
4,000 % fällig am 01.08.2053	$ 411.400	$ 386.443	3,68
4,500 % fällig am 01.08.2053	68.600	65.990	0,63
5,000 % fällig am 01.07.2053	101.200	99.184	0,94
		671.151	6,39
US-SCHATZOBLIGATIONEN			
U.S. Treasury Bonds			
1,375 % fällig am 15.11.2040	149.120	99.887	0,95
1,750 % fällig am 15.08.2041	81.800	57.528	0,55
1,875 % fällig am 15.02.2041	297.100	215.989	2,06
1,875 % fällig am 15.11.2051	66.350	43.827	0,42
2,000 % fällig am 15.11.2041	189.400	138.773	1,32
2,250 % fällig am 15.05.2041	68.000	52.425	0,50
2,250 % fällig am 15.08.2046	220	161	0,00
2,375 % fällig am 15.02.2042	53.700	41.834	0,40
2,500 % fällig am 15.02.2045	28.750	22.274	0,21
2,750 % fällig am 15.11.2047	1.133	912	0,01
2,875 % fällig am 15.11.2046	1.461	1.205	0,01
2,875 % fällig am 15.05.2049	6.555	5.423	0,05
3,000 % fällig am 15.05.2045	32.725	27.661	0,27
3,000 % fällig am 15.02.2048	40.992	34.587	0,33
3,125 % fällig am 15.08.2044	25.700	22.253	0,21
3,125 % fällig am 15.05.2048	29.360	25.347	0,24
3,250 % fällig am 15.05.2042	141.316	126.174	1,20
3,375 % fällig am 15.08.2042	2.000	1.816	0,02
U.S. Treasury Inflation Protected Securities (f)			
1,500 % fällig am 15.02.2053	96.589	93.868	0,89
U.S. Treasury Notes			
3,875 % fällig am 30.09.2029	206.000	204.016	1,94
4,625 % fällig am 15.03.2026	460	461	0,01
U.S. Treasury STRIPS			
0,000 % fällig am 15.05.2043 (e)	25	11	0,00
		1.216.432	11,59
	AKTIEN		
OPTIONSSCHEINE			
Guaranteed Rate, Inc. - Exp. 31.12.2060	7.228	0	0,00
Summe USA		5.450.372	51,94
	PAR (000S)		
JUNGFERNINSELN (BRITISCH)			
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL			
Champion Path Holdings Ltd.			
4,500 % fällig am 27.01.2026	$ 9.900	8.753	0,08
4,850 % fällig am 27.01.2028	13.700	11.097	0,11
CLP Power Hong Kong Financing Ltd.			
2,125 % fällig am 30.06.2030	16.900	14.041	0,13
Gold Fields Orogen Holdings BVI Ltd.			
6,125 % fällig am 15.05.2029	3.800	3.847	0,04
JMH Co. Ltd.			
2,500 % fällig am 09.04.2031	4.900	4.109	0,04
Summe Jungferninseln (Britisch)		41.847	0,40
KURZFRISTIGE INSTRUMENTE			
COMMERCIAL PAPER			
Amcor PLC			
5,430 % fällig am 13.07.2023	300	299	0,00
5,450 % fällig am 10.07.2023	600	599	0,01
5,450 % fällig am 11.07.2023	400	399	0,00

BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
Ameren Corp.			
5,400 % fällig am 21.07.2023	$ 1.300	$ 1.296	0,01
American Electric Power Co., Inc.			
5,430 % fällig am 10.07.2023	7.500	7.489	0,07
5,480 % fällig am 01.08.2023	5.800	5.772	0,06
5,480 % fällig am 14.08.2023	6.800	6.753	0,07
AT+T, Inc.			
5,700 % fällig am 19.03.2024	32.000	30.633	0,29
Becton Dickinson and Co.			
5,390 % fällig am 10.07.2023	3.100	3.096	0,03
Consolidated Edison Co. of New York, Inc.			
5,420 % fällig am 17.07.2023	8.600	8.578	0,08
5,430 % fällig am 25.07.2023	3.400	3.387	0,03
Constellation Brands, Inc.			
5,590 % fällig am 03.07.2023	3.300	3.299	0,03
5,590 % fällig am 05.07.2023	2.000	1.998	0,02
5,600 % fällig am 11.07.2023	250	250	0,00
5,610 % fällig am 11.07.2023	250	250	0,00
Dominion Resources, Inc.			
5,400 % fällig am 05.07.2023	600	600	0,01
5,400 % fällig am 19.07.2023	400	399	0,00
Duke Energy Corp.			
5,400 % fällig am 10.07.2023	4.500	4.493	0,04
Electricite de France S.A.			
5,510 % fällig am 03.08.2023	5.050	5.023	0,05
5,510 % fällig am 04.08.2023	6.600	6.564	0,06
Enbridge, Inc.			
5,400 % fällig am 12.07.2023	3.300	3.294	0,03
5,440 % fällig am 20.07.2023	7.200	7.178	0,07
5,470 % fällig am 14.07.2023	250	249	0,00
5,470 % fällig am 20.07.2023	700	698	0,01
Enel Finance America LLC			
5,450 % fällig am 06.07.2023	4.700	4.696	0,05
5,450 % fällig am 24.07.2023	900	897	0,01
5,450 % fällig am 26.07.2023	300	299	0,00
Entergy Corp.			
5,380 % fällig am 14.07.2023	1.900	1.896	0,02
5,450 % fällig am 20.07.2023	1.000	997	0,01
Humana, Inc.			
5,450 % fällig am 19.07.2023	1.200	1.197	0,01
J.M. Smucker Co.			
5,410 % fällig am 17.07.2023	1.400	1.396	0,01
5,450 % fällig am 12.07.2023	4.400	4.392	0,04
Leidos, Inc.			
5,900 % fällig am 10.07.2023	10.200	10.184	0,10
Marriott International, Inc.			
5,450 % fällig am 04.08.2023	700	696	0,01
McCormick & Co., Inc.			
5,350 % fällig am 25.07.2023	300	299	0,00
Mondelez International, Inc.			
5,370 % fällig am 24.07.2023	750	747	0,01
5,370 % fällig am 25.07.2023	750	747	0,01
5,430 % fällig am 13.07.2023	1.300	1.298	0,01
5,430 % fällig am 14.07.2023	1.300	1.297	0,01
Penske Truck Leasing Co. LP			
5,350 % fällig am 11.07.2023	4.600	4.593	0,04
5,350 % fällig am 14.07.2023	250	249	0,00
Quanta Services, Inc.			
5,900 % fällig am 05.07.2023	250	250	0,00
5,900 % fällig am 11.07.2023	250	250	0,00

BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
Republic Services, Inc.			
5,250 % fällig am 05.07.2023	$ 1.300	$ 1.299	0,01
S&P Global, Inc.			
5,400 % fällig am 06.07.2023	3.600	3.597	0,04
Sempra Energy			
5,400 % fällig am 05.07.2023	300	300	0,00
Thomson Reuters Corp.			
5,470 % fällig am 12.07.2023	11.900	11.879	0,11
5,470 % fällig am 13.07.2023	5.700	5.689	0,05
5,470 % fällig am 18.07.2023	6.900	6.882	0,07
5,500 % fällig am 18.07.2023	500	499	0,01
5,500 % fällig am 19.07.2023	4.200	4.188	0,04
VW Credit, Inc.			
5,400 % fällig am 21.07.2023	5.800	5.782	0,06
5,400 % fällig am 26.07.2023	800	797	0,01
5,400 % fällig am 28.07.2023	300	299	0,00
Walgreens Boots Alliance			
6,000 % fällig am 05.07.2023	7.800	7.794	0,08
Summe kurzfristige Instrumente		187.981	1,79
Summe Übertragbare Wertpapiere		**$ 9.186.690**	**87,55**
	AKTIEN		
INVESTMENTFONDS			
ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN			
PIMCO Funds: Global Investors Series plc - Asia Strategic Interest Bond Fund (h)	3.787.451	33.860	0,32
PIMCO Funds: Global Investors Series plc - PIMCO Asia High Yield Bond Fund (h)	11.356.637	103.232	0,99
PIMCO Funds: Global Investors Series plc - PIMCO European High Yield Bond Fund (h)	3.637.652	41.195	0,39
PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (h)	62.054.231	617.934	5,89
PIMCO Specialty Funds Ireland p.l.c. - PIMCO China Bond Fund (h)	329.257	4.290	0,04
		800.511	7,63
BÖRSENGEHANDELTE FONDS			
PIMCO ETFs plc - PIMCO US Dollar Short Maturity UCITS ETF (h)	2.587.040	256.971	2,45
Summe Investmentfonds		**$ 1.057.482**	**10,08**

* Das Engagement des Global Investment Grade Credit Fund in den Anlagefonds stieg etwas über 10 %. Ab dem 3. Juli 2023 erfüllte der Fonds die Vorgaben wieder.

PENSIONSGESCHÄFTE

Kontrahent	Kredit-zins	Abrechnungs-datum	Fälligkeits-datum	Kapital-betrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensions-geschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensions-geschäft[1]	% des Nettovermögens
BRC	5,120 %	30.06.2023	03.07.2023	$ 472.200	U.S. Treasury Notes 3,875 % - 4,625 % fällig am 30.04.2025 - 30.06.2025	$ (481.979)	$ 472.200	$ 472.401	4,50
FICC	2,400	30.06.2023	03.07.2023	57.832	U.S. Treasury Notes 4,625 % fällig am 30.06.2025	(58.989)	57.832	57.844	0,55
	5,010	30.06.2023	03.07.2023	21.500	U.S. Treasury Notes 3,500 % fällig am 30.04.2028	(21.930)	21.500	21.500	0,20
SAL	5,100	30.06.2023	03.07.2023	8.000	U.S. Treasury Notes 0,250 % fällig am 31.10.2025	(8.161)	8.000	8.003	0,08
Summe Pensionsgeschäfte						**$ (571.059)**	**$ 559.532**	**$ 559.748**	**5,33**

[1] Umfasst aufgelaufene Zinsen.

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

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

FUTURES

Beschreibung	Art	Ablauf-monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
3-Month SOFR December Futures	Long	03.2024	836	$ (1.329)	(0,01)
Euro-Bobl September Futures	Long	09.2023	8	(14)	0,00
Euro-BTP Italy Government Bond September Futures	Long	09.2023	455	464	0,00
Euro-Bund 10-Year Bond September Futures	Long	09.2023	3.648	(5.734)	(0,06)
Euro-Buxl 30-Year Bond September Futures	Long	09.2023	15	33	0,00
Euro-Schatz September Futures	Long	09.2023	2.163	(1.530)	(0,01)
U.S. Treasury 10-Year Note September Futures	Long	09.2023	205	(194)	0,00
U.S. Treasury 10-Year Ultra September Futures	Short	09.2023	306	286	0,00
United Kingdom Long Gilt September Futures	Long	09.2023	598	(343)	0,00
				$ (8.361)	(0,08)

VERKAUFSOPTIONEN

OPTIONEN AUF BÖRSENGEHANDELTE TERMINKONTRAKTE

Beschreibung	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Anzahl der Kontrakte	Aufgeld	Markt-wert	% des Nettovermögens
Put - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note August Futures	$ 111,500	21.07.2023	252	$ (110)	$ (95)	0,00
Call - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note August Futures	115,500	21.07.2023	252	(88)	(12)	0,00
Put - CBOT U.S. Treasury 30-Year Bond August Futures	123,000	21.07.2023	72	(28)	(11)	0,00
Call - CBOT U.S. Treasury 30-Year Bond August Futures	131,000	21.07.2023	72	(37)	(14)	0,00
				$ (263)	$ (132)	0,00
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate					**$ (8.493)**	**(0,08)**

ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)

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

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMMISSIONEN - SCHUTZKAUF[1]

Referenzeinheit	Zu bezahlender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag[3]	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Toll Brothers Finance Corp.	(1,000) %	20.06.2024	$ 23.500	$ (152)	0,00

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMMISSIONEN - SCHUTZVERKAUF[2]

Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag[3]	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
AES Corp.	5,000 %	20.12.2025	$ 7.900	$ (781)	(0,01)
AES Corp.	5,000	20.06.2026	2.400	(217)	0,00
Airbus Finance BV	1,000	20.12.2025	€ 10.300	27	0,00
American International Group, Inc.	1,000	20.12.2027	$ 8.000	137	0,00
AT&T, Inc.	1,000	20.12.2023	12.100	(119)	0,00
AT&T, Inc.	1,000	20.06.2024	3.400	16	0,00
AT&T, Inc.	1,000	20.12.2024	7.600	(86)	0,00
AT&T, Inc.	1,000	20.12.2025	2.000	(11)	0,00
AT&T, Inc.	1,000	20.06.2026	54.000	(482)	(0,01)
AT&T, Inc.	1,000	20.12.2026	1.300	(12)	0,00
AT&T, Inc.	1,000	20.06.2028	29.600	208	0,00
Atlantia SpA	1,000	20.12.2025	€ 1.800	75	0,00
Boeing Co.	1,000	20.06.2025	$ 7.000	156	0,00
Boeing Co.	1,000	20.12.2025	900	22	0,00
Boeing Co.	1,000	20.06.2026	1.000	15	0,00
BP Capital Markets PLC	1,000	20.12.2025	€ 6.800	(22)	0,00
British Telecommunications PLC	1,000	20.12.2024	23.900	(26)	0,00
British Telecommunications PLC	1,000	20.12.2025	6.000	15	0,00
British Telecommunications PLC	1,000	20.12.2027	500	7	0,00
British Telecommunications PLC	1,000	20.06.2028	20.400	(48)	0,00
British Telecommunications PLC	1,000	20.12.2028	1.100	0	0,00
Ford Motor Co.	5,000	20.12.2024	$ 5.000	(304)	0,00
General Electric Co.	1,000	20.06.2024	32.050	268	0,00
General Electric Co.	1,000	20.12.2024	27.900	555	0,01
General Electric Co.	1,000	20.06.2026	18.750	(10)	0,00
General Electric Co.	1,000	20.12.2026	2.000	0	0,00
General Motors Co.	5,000	20.12.2026	2.050	(165)	0,00
General Motors Co.	5,000	20.06.2028	2.435	53	0,00
Glencore Finance Europe Ltd.	5,000	20.06.2028	€ 2.700	10	0,00
Hess Corp.	1,000	20.06.2026	$ 7.000	100	0,00
International Lease Finance Corp.	5,000	20.12.2023	6.100	(792)	(0,01)
Lennar Corp.	5,000	20.12.2026	3.200	(223)	0,00
MetLife, Inc.	1,000	20.12.2023	11.000	346	0,00
MetLife, Inc.	1,000	20.06.2028	600	10	0,00

Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag[3]	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
NextEra Energy Capital Holdings, Inc.	1,000 %	20.06.2026	$ 11.300	$ (98)	0,00
Rolls-Royce PLC	1,000	20.06.2024	€ 25.300	(222)	0,00
Rolls-Royce PLC	1,000	20.12.2024	9.000	(58)	0,00
Southwest Airlines Co.	1,000	20.12.2026	$ 3.100	40	0,00
T-Mobile USA, Inc.	5,000	20.06.2028	7.800	22	0,00
Telefonica Emisiones S.A.	1,000	20.06.2028	€ 24.800	(45)	0,00
Tesco PLC	1,000	20.12.2024	63.700	761	0,01
Tesco PLC	1,000	20.12.2027	4.700	39	0,00
Tesco PLC	1,000	20.06.2028	7.300	(23)	0,00
Verizon Communications, Inc.	1,000	20.06.2026	$ 1.900	(29)	0,00
Verizon Communications, Inc.	1,000	20.12.2027	500	11	0,00
Verizon Communications, Inc.	1,000	20.06.2028	11.700	47	0,00
Vodafone Group PLC	1,000	20.06.2024	€ 12.700	(65)	0,00
Volkswagen International Finance NV	1,000	20.12.2026	4.100	(77)	0,00
Volkswagen International Finance NV	1,000	20.06.2028	11.100	(167)	0,00
				$ (1.142)	(0,01)

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES - SCHUTZVERKAUF[2]

Index/Tranchen	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag[3]	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
CDX.IG-39 5-Year Index	1,000 %	20.12.2027	$ 89.300	$ 824	0,01
CDX.IG-40 5-Year Index	1,000	20.06.2028	903.500	6.634	0,06
iTraxx Crossover 39 5-Year Index	5,000	20.06.2028	€ 12.100	416	0,01
				$ 7.874	0,08

ZINSSWAPS

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Zahlung	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	1,175 %	28.02.2052	£ 7.200	$ (4.109)	(0,04)
Zahlung[4]	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	3,750	20.09.2028	72.000	(2.788)	(0,03)
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,000	15.12.2023	¥ 910.000	9	0,00
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,000	15.09.2024	1.829.900	9	0,00
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,300	20.03.2028	1.192.900	0	0,00
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,000	15.06.2027	$ 160.000	11.897	0,11
Erhalt[4]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,450	20.12.2024	427.700	10.167	0,10
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	1,500	17.06.2030	CAD 244.800	(17.861)	(0,17)
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	0,000	17.03.2053	€ 88.530	41.610	0,40
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	0,175	17.03.2033	265.610	(70.613)	(0,67)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	0,550	10.08.2024	31.200	(1.394)	(0,01)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	0,650	12.04.2027	88.900	(9.442)	(0,09)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	0,700	11.04.2027	20.800	(2.180)	(0,02)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	1,000	13.05.2027	62.700	(5.881)	(0,06)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	1,000	18.05.2027	28.000	(2.625)	(0,03)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,547	09.03.2033	24.000	(533)	(0,01)
Zahlung[4]	6-Month EUR-EURIBOR	3,000	20.09.2033	76.300	663	0,01
Zahlung	6-Month HUF-BBR	1,000	19.09.2023	HUF 37.770.400	(6.154)	(0,06)
Zahlung	6-Month HUF-BBR	1,250	19.09.2023	16.157.700	(3.275)	(0,03)
					$ (62.500)	(0,60)
Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate					**$ (55.920)**	**(0,53)**

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

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

(3) Der maximal mögliche Betrag, den der Fonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

(4) Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft.

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

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

VERKAUFSOPTIONEN

ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag[1]	Aufgeld	Markt-wert	% des Nettovermö-gens
BOA	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,380 %	31.07.2023	11.400	$ (44)	$ (54)	(0,01)
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,780	31.07.2023	11.400	(44)	(34)	0,00
	Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,070	10.07.2023	7.900	(52)	(20)	0,00
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,370	10.07.2023	7.900	(52)	(6)	0,00
	Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,060	14.07.2023	4.300	(31)	(19)	0,00
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,360	14.07.2023	4.300	(31)	(10)	0,00
BPS	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,200	06.07.2023	5.400	(17)	0	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,650	06.07.2023	5.400	(17)	(6)	0,00
	Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,000	03.07.2023	4.400	(30)	0	0,00
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,400	03.07.2023	4.400	(30)	0	0,00
BRC	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,260	26.07.2023	4.300	(14)	(9)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,660	26.07.2023	4.300	(14)	(21)	0,00
	Call - OTC 7-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,350	27.07.2023	5.300	(12)	(10)	0,00
	Put - OTC 7-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,850	27.07.2023	5.300	(12)	(19)	0,00
FAR	Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,000	03.07.2023	4.600	(32)	0	0,00
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,400	03.07.2023	4.600	(32)	0	0,00
GLM	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,260	26.07.2023	4.400	(14)	(9)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,660	26.07.2023	4.400	(14)	(21)	0,00
	Call - OTC 7-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,350	27.07.2023	5.200	(12)	(10)	0,00
	Put - OTC 7-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,850	27.07.2023	5.200	(12)	(18)	0,00
JPM	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,300	10.07.2023	5.500	(20)	(2)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,750	10.07.2023	5.500	(20)	(3)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,250	20.07.2023	12.200	(42)	(16)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,650	20.07.2023	12.200	(42)	(51)	0,00
MYC	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,200	06.07.2023	5.400	(17)	0	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,650	06.07.2023	5.400	(17)	(6)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,300	10.07.2023	5.400	(19)	(2)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,750	10.07.2023	5.400	(19)	(3)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,270	24.07.2023	5.400	(18)	(10)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,670	24.07.2023	5.400	(18)	(22)	0,00
							$ (748)	$ (381)	(0,01)

OPTIONEN AUF WERTPAPIERE

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag[1]	Aufgeld	Markt wert	% des Nettovermö-gens
SAL	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security. TBA 4,500 % fällig am 01.08.2053	$ 95,875	07.08.2023	14.300	$ (85)	$ (84)	0,00
	Call - OTC Uniform Mortgage-Backed Security. TBA 4,500 % fällig am 01.08.2053	97,875	07.08.2023	14.300	(78)	(20)	0,00
					$ (163)	$ (104)	0,00

[1] Der Nennbetrag stellt die Anzahl der Kontrakte dar.

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMMISSIONEN - SCHUTZVERKAUF[1]

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag[2]	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Markt-wert	% des Nettovermö-gens
BOA	Brazil Government International Bond	1,000 %	20.06.2026	$ 1.100	$ (38)	$ 43	$ 5	0,00
	Italy Government International Bond	1,000	20.06.2024	14.500	(304)	435	131	0,00
	Italy Government International Bond	1,000	20.06.2025	14.200	(395)	568	173	0,00
BRC	Italy Government International Bond	1,000	20.06.2024	13.500	(294)	416	122	0,00
	Italy Government International Bond	1,000	20.12.2024	22.100	93	189	282	0,00
	Italy Government International Bond	1,000	20.06.2025	62.700	(1.024)	1.821	797	0,01
	NextEra Energy Capital Holdings, Inc.	1,000	20.12.2025	7.800	170	(68)	102	0,00
	South Africa Government International Bond	1,000	20.12.2024	31.400	(1.186)	1.046	(140)	0,00
CBK	Intrum AB	5,000	20.12.2024	€ 3.000	286	(491)	(205)	0,00
	Italy Government International Bond	1,000	20.06.2025	$ 11.100	(270)	406	136	0,00
DUB	Saudi Arabia Government International Bond	1,000	20.06.2025	5.700	(5)	81	76	0,00
GLM	Italy Government International Bond	1,000	20.06.2025	44.900	(502)	1.235	733	0,01
GST	Equinix, Inc.	5,000	20.06.2027	4.500	629	(52)	577	0,01
	Intrum AB	5,000	20.12.2024	€ 15.100	1.697	(2.727)	(1.030)	(0,01)
	Saudi Arabia Government International Bond	1,000	20.06.2025	$ 5.700	(7)	83	76	0,00
	Saudi Arabia Government International Bond	1,000	20.12.2026	1.400	33	(8)	25	0,00
	South Africa Government International Bond	1,000	20.12.2024	5.700	(229)	204	(25)	0,00
JLN	Intrum AB	5,000	20.12.2024	€ 5.000	560	(901)	(341)	0,00
JPM	Banco do Brasil S.A.	1,000	20.12.2024	$ 4.400	(99)	63	(36)	0,00
	NextEra Energy Capital Holdings, Inc.	1,000	20.06.2024	16.300	223	(106)	117	0,00
	NextEra Energy Capital Holdings, Inc.	1,000	20.12.2024	8.100	112	(35)	77	0,00
	Saudi Arabia Government International Bond	1,000	20.06.2025	7.600	(1)	103	102	0,00
MYC	Brazil Government International Bond	1,000	20.06.2027	15.800	(978)	811	(167)	0,00
	Brookfield Asset Management, Inc.	1,000	20.06.2025	7.900	0	(63)	(63)	0,00
	Consolidated Edison Co. of New York, Inc.	1,000	20.12.2024	16.500	322	(119)	203	0,00
	Pioneer Natural Resources Co.	1,000	20.06.2025	8.400	(408)	520	112	0,00
MYI	Intrum AB	5,000	20.12.2024	€ 2.700	311	(495)	(184)	0,00
					$ (1.304)	$ 2.959	$ 1.655	0,02

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES - SCHUTZVERKAUF[1]

Kontrahent	Index/Tranchen	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag[2]	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Markt-wert	% des Nettovermögens
BPS	CDX.HY-31 5-Year Index 25-35 %	5,000 %	20.12.2023	$ 5.80	$ 676	$ (532)	$ 144	0,00
BRC	iTraxx Japan 39 5-Year Index	1,000	20.06.2028	¥ 13.027.00	499	755	1.254	0,01
CBK	CDX.HY-31 5-Year Index 25-35 %	5,000	20.12.2023	$ 8.00	828	(629)	199	0,00
GST	CDX.HY-31 5-Year Index 25-35 %	5,000	20.12.2023	24.00	2.849	(2.253)	596	0,01
JPM	CDX.HY-31 5-Year Index 25-35 %	5,000	20.12.2023	44.30	5.450	(4.349)	1.101	0,01
	iTraxx Japan 39 5-Year Index	1,000	20.06.2028	¥ 4.024.00	108	279	387	0,01
MYC	CDX.HY-31 5-Year Index 25-35 %	5,000	20.12.2023	$ 6.60	784	(620)	164	0,00
					$ 11.194	$ (7.349)	$ 3.845	0,04

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

(2) Der maximal mögliche Betrag, den der Fonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung		Zu erhaltende Währung		Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
AZD	07.2023	AUD	2.061	$	1.349	$ 0	$ (23)	$ (23)	0,00
	07.2023	$	7.525	AUD	11.340	23	0	23	0,00
	08.2023	AUD	11.340	$	7.531	0	(23)	(23)	0,00
BOA	07.2023		19.171		12.507	0	(254)	(254)	0,00
	07.2023	CAD	194.652		143.054	0	(4.047)	(4.047)	(0,04)
	07.2023	DKK	39.871		5.758	0	(85)	(85)	0,00
	07.2023	£	1.232		1.558	0	(8)	(8)	0,00
	07.2023	$	10.635	DKK	72.307	0	(40)	(40)	0,00
	07.2023		33.407	€	30.900	316	(11)	305	0,00
	07.2023		53.907	¥	7.498.900	0	(2.024)	(2.024)	(0,02)
	07.2023		30.438	MXN	560.360	2.153	0	2.153	0,02
	08.2023	DKK	72.186	$	10.635	40	0	40	0,00
	09.2023	INR	959		12	0	0	0	0,00
	09.2023	KRW	76.331		60	2	0	2	0,00
	09.2023	$	4.348	IDR	65.090.309	0	(25)	(25)	0,00
BPS	07.2023	€	1.318.551	$	1.417.573	0	(20.968)	(20.968)	(0,20)
	07.2023	$	5.370	AUD	8.107	27	0	27	0,00
	07.2023		174	CHF	156	0	0	0	0,00
	07.2023		52.119	€	47.721	5	(60)	(55)	0,00
	07.2023		49.940	¥	6.941.546	0	(1.913)	(1.913)	(0,02)
	07.2023		7.308	MXN	130.668	298	0	298	0,00
	08.2023	AUD	8.107	$	5.374	0	(27)	(27)	0,00
	08.2023	CHF	155		174	0	0	0	0,00
	08.2023	$	55.207	¥	7.932.000	24	0	24	0,00
	08.2023	ZAR	137.691	$	7.416	157	0	157	0,00
	09.2023	$	4.509	IDR	67.761.328	0	(8)	(8)	0,00
	09.2023		890	PEN	3.258	3	0	3	0,00
	10.2023	ZAR	263.125	$	14.135	353	0	353	0,00
	12.2023	$	1.134	MXN	20.219	10	0	10	0,00
BRC	07.2023	PEN	50.187	$	13.718	0	(128)	(128)	0,00
	07.2023	$	21.192	£	16.801	185	(17)	168	0,00
	07.2023		13.711	PEN	50.187	127	0	127	0,00
	08.2023	CLP	78.489	$	96	0	(1)	(1)	0,00
	08.2023	$	30.801	COP	131.218.774	236	0	236	0,00
	08.2023	ZAR	286.354	$	15.180	191	(105)	86	0,00
	09.2023	IDR	163.629		11	0	0	0	0,00
	09.2023	PEN	376.007		102.259	0	(851)	(851)	(0,01)
BSH	09.2023	$	7.552	PEN	27.887	99	0	99	0,00
CBK	07.2023	AUD	7.159	$	4.671	0	(95)	(95)	0,00
	07.2023	$	8.847	€	8.181	84	(6)	78	0,00
	07.2023		9.735	£	7.675	22	0	22	0,00
	07.2023		7.308	MXN	130.664	297	0	297	0,00
	07.2023		59.488	PEN	223.029	2.007	0	2.007	0,02
	08.2023	CLP	18.085.756	$	22.033	0	(351)	(351)	0,00
	08.2023	CNH	101		14	1	0	1	0,00
	08.2023	SEK	1.637		161	10	0	10	0,00
	08.2023	$	22.200	CLP	18.164.245	281	0	281	0,00
	08.2023		8.714	NOK	90.901	0	(217)	(217)	0,00
	10.2023		1.548	CLP	1.268.928	15	0	15	0,00
DUB	07.2023		525	BRL	2.842	65	0	65	0,00
	07.2023		16.206	£	12.998	319	0	319	0,00
	09.2023	PEN	544	$	148	0	(1)	(1)	0,00
	10.2023	ZAR	110.471		6.066	279	0	279	0,00
FAR	07.2023	PEN	54.587		14.998	0	(50)	(50)	0,00
	08.2023	$	14.998	PEN	54.743	43	0	43	0,00
GLM	07.2023	BRL	70.572	$	14.616	0	(14)	(14)	0,00

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung		Zu erhaltende Währung		Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
	07.2023	$	12.533	BRL	67.506	$ 1.461	$ 0	$ 1.461	0,02
	07.2023		2.569	PEN	9.379	15	0	15	0,00
	08.2023		3.831	NOK	40.652	0	(31)	(31)	0,00
	09.2023	BRL	14.376	$	2.854	0	(93)	(93)	0,00
	09.2023	$	14.616	BRL	71.354	11	0	11	0,00
	09.2023		5.177	PEN	18.922	12	0	12	0,00
IND	07.2023	DKK	117.175	$	16.913	0	(255)	(255)	0,00
	08.2023	$	9.838	NOK	103.111	0	(199)	(199)	0,00
JPM	07.2023	AUD	15.930	$	10.415	0	(189)	(189)	0,00
	07.2023	£	4.810		6.081	0	(33)	(33)	0,00
	07.2023	¥	4.917.636		34.387	363	0	363	0,00
	07.2023	$	1.577	CAD	2.092	4	0	4	0,00
	07.2023		1.328.758	€	1.217.147	235	(1.085)	(850)	(0,01)
	07.2023		798	MXN	14.030	19	0	19	0,00
	08.2023	€	1.206.366	$	1.319.073	1.126	0	1.126	0,01
	08.2023	HUF	7.853.166		22.608	41	(120)	(79)	0,00
	08.2023	$	6.082	£	4.810	33	0	33	0,00
	08.2023		34.387	¥	4.896.739	0	(364)	(364)	0,00
	08.2023		888	MXN	15.390	2	0	2	0,00
	08.2023		1.413	NOK	14.990	0	(12)	(12)	0,00
	08.2023		1.308	ZAR	23.940	0	(46)	(46)	0,00
	08.2023	ZAR	134	$	7	0	0	0	0,00
	09.2023	$	1.818	IDR	27.350.116	0	(1)	(1)	0,00
	09.2023		17.251	INR	1.421.764	31	0	31	0,00
	09.2023		4.619	PEN	16.901	18	0	18	0,00
MBC	07.2023	CAD	3.656	$	2.741	0	(22)	(22)	0,00
	07.2023	€	22.076		23.676	0	(409)	(409)	0,00
	07.2023	£	275.719		341.314	0	(9.222)	(9.222)	(0,09)
	07.2023	$	1.647	CAD	2.232	40	0	40	0,00
	07.2023		25.247	€	23.435	321	0	321	0,00
	09.2023	KRW	141.506	$	111	3	0	3	0,00
MYI	07.2023	€	1.008		1.099	0	(1)	(1)	0,00
	07.2023	£	80		101	0	(1)	(1)	0,00
	07.2023	IDR	17.158.597		1.147	3	0	3	0,00
	07.2023	SGD	71		53	0	0	0	0,00
	07.2023	$	111	CHF	99	0	0	0	0,00
	07.2023		9.453	DKK	64.485	0	(5)	(5)	0,00
	07.2023		15.606	€	14.430	137	0	137	0,00
	07.2023		32.574	£	26.082	587	(2)	585	0,01
	07.2023		1.142	IDR	17.158.597	2	0	2	0,00
	07.2023		2	SEK	23	0	0	0	0,00
	08.2023	DKK	64.377	$	9.453	5	0	5	0,00
	08.2023	$	2.251	ZAR	41.194	0	(79)	(79)	0,00
	09.2023	KRW	159.031	$	124	3	0	3	0,00
	09.2023	$	4.518	IDR	67.514.158	0	(34)	(34)	0,00
	09.2023		3.723	INR	307.093	10	0	10	0,00
RBC	07.2023	MXN	16.241	$	844	0	(101)	(101)	0,00
	08.2023	$	5.183	MXN	89.828	12	0	12	0,00
SCX	07.2023	AUD	22.487	$	14.694	0	(274)	(274)	0,00
	07.2023	CHF	164		182	0	(1)	(1)	0,00
	07.2023	$	11.057	AUD	16.657	30	0	30	0,00
	08.2023	AUD	16.657	$	11.066	0	(30)	(30)	0,00
	09.2023	$	16.887	IDR	252.117.291	0	(140)	(140)	0,00
	09.2023		10.796	INR	889.196	12	0	12	0,00
	09.2023		10.260	PEN	37.754	98	0	98	0,00
SOG	07.2023	AUD	13.613	$	8.906	0	(155)	(155)	0,00
	07.2023	PLN	1.619		376	0	(22)	(22)	0,00
SSB	07.2023	PEN	104.373		28.615	0	(164)	(164)	0,00
	08.2023	$	28.575	PEN	104.373	147	0	147	0,00
TOR	07.2023	AUD	7.204	$	4.712	0	(84)	(84)	0,00
	07.2023	$	13.539	AUD	20.498	106	0	106	0,00
	07.2023		148.194	CAD	196.089	102	(108)	(6)	0,00
	07.2023		287.423	£	226.192	147	0	147	0,00
	08.2023	AUD	20.498	$	13.550	0	(105)	(105)	0,00
	08.2023	CAD	196.011		148.194	107	(102)	5	0,00
	08.2023	£	226.192		287.485	0	(142)	(142)	0,00
	10.2023	CLP	1.268.928		1.540	0	(23)	(23)	0,00
UAG	07.2023	AUD	1.649		1.079	0	(18)	(18)	0,00
	07.2023	$	21.815	AUD	32.669	46	(114)	(68)	0,00
	07.2023		138	MXN	2.464	5	0	5	0,00
	08.2023	AUD	32.669	$	21.832	114	(46)	68	0,00
	08.2023	ZAR	180.831		9.421	3	(113)	(110)	0,00
	09.2023		185.425		10.576	828	0	828	0,01
	10.2023		35.601		1.923	58	0	58	0,00
						$ 13.969	$ (45.297)	$ (31.328)	(0,30)

ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklassen Institutional AUD (Hedged) ausschüttend und Investor AUD (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
AZD	07.2023	AUD 851	$ 565	$ 0	$ (2)	$ (2)	0,00
	07.2023	$ 1.067	AUD 1.630	18	0	18	0,00
	08.2023	565	851	2	0	2	0,00
BOA	07.2023	AUD 17	$ 11	0	0	0	0,00
	07.2023	$ 3.319	AUD 5.106	80	0	80	0,00
BPS	07.2023	AUD 4.482	$ 2.967	0	(16)	(16)	0,00
	07.2023	$ 2.769	AUD 4.268	72	0	72	0,00
	08.2023	2.883	4.349	14	0	14	0,00
CBK	07.2023	914	1.383	14	(7)	7	0,00
MBC	07.2023	AUD 75	$ 49	0	0	0	0,00
SCX	07.2023	1.501	996	0	(3)	(3)	0,00
	07.2023	$ 821	AUD 1.256	15	0	15	0,00
	08.2023	997	1.501	3	0	3	0,00
UAG	07.2023	AUD 5.197	$ 3.453	8	(15)	(7)	0,00
	07.2023	$ 1.269	AUD 1.939	21	0	21	0,00
	08.2023	3.357	5.052	15	(6)	9	0,00
				$ 262	$ (49)	$ 213	0,00

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklassen Institutional CHF (Hedged) thesaurierend, Institutional CHF (Hedged) ausschüttend, Investor CHF (Hedged) thesaurierend, Investor CHF (Hedged) ausschüttend, Administrative CHF (Hedged) thesaurierend, Class E CHF (Hedged) thesaurierend und Class W CHF (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2023	CHF 186	$ 208	$ 0	$ 0	$ 0	0,00
	07.2023	$ 19	CHF 17	0	0	0	0,00
BPS	07.2023	CHF 209.112	$ 233.815	79	0	79	0,00
	07.2023	$ 318.182	CHF 287.839	3.552	0	3.552	0,03
	08.2023	233.815	208.517	0	(79)	(79)	0,00
IND	07.2023	CHF 110.524	$ 123.042	0	(496)	(496)	0,00
	08.2023	$ 123.042	CHF 110.209	496	0	496	0,00
JPM	07.2023	CHF 75	$ 83	0	(1)	(1)	0,00
MBC	07.2023	2.354	2.623	0	(8)	(8)	0,00
	07.2023	$ 181	CHF 163	0	0	0	0,00
MYI	07.2023	CHF 9.715	$ 10.745	0	(115)	(115)	0,00
	07.2023	$ 4.647	CHF 4.201	49	0	49	0,00
RBC	07.2023	CHF 113	$ 127	0	0	0	0,00
RYL	07.2023	49	55	0	0	0	0,00
SCX	07.2023	1.132	1.253	0	(13)	(13)	0,00
	07.2023	$ 222.524	CHF 199.944	964	0	964	0,01
UAG	07.2023	CHF 216.943	$ 242.011	0	(478)	(478)	0,00
	07.2023	$ 200.590	CHF 180.239	873	0	873	0,01
	08.2023	241.279	215.670	475	0	475	0,00
				$ 6.488	$ (1.190)	$ 5.298	0,05

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklasse Institutional CZK (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BPS	07.2023	$ 3.719	CZK 81.931	$ 44	$ 0	$ 44	0,00
DUB	07.2023	3.758	83.597	81	0	81	0,00
MYI	07.2023	CZK 82.828	$ 3.818	15	0	15	0,00
	07.2023	$ 39	CZK 872	1	0	1	0,00
	08.2023	3.818	82.930	0	(15)	(15)	0,00
UAG	07.2023	3.702	81.871	58	0	58	0,00
				$ 199	$ (15)	$ 184	0,00

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklassen Institutional EUR (Currency Exposure) thesaurierend, Institutional USD (Currency Exposure) thesaurierend, Institutional USD (Currency Exposure) ausschüttend, E Class EUR (Currency Exposure) ausschüttend und H Institutional USD (Currency Exposure) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
AZD	07.2023	AUD 401	$ 266	$ 0	$ (1)	$ (1)	0,00
	07.2023	$ 119	AUD 182	2	0	2	0,00
	08.2023	266	401	1	0	1	0,00
BOA	07.2023	€ 53	$ 57	0	(1)	(1)	0,00
	07.2023	¥ 56	0	0	0	0	0,00
	07.2023	SEK 662	61	0	0	0	0,00
	07.2023	$ 148	AUD 229	4	0	4	0,00
	07.2023	4.906	CAD 6.676	139	0	139	0,00
	07.2023	0	€ 0	0	0	0	0,00

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung		Zu erhaltende Währung		Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
	07.2023	$	27	NZD	45	$ 0	$ 0	$ 0	0,00
	07.2023		1	SEK	13	0	0	0	0,00
	08.2023		61		661	0	0	0	0,00
BPS	07.2023	AUD	287	$	190	0	(1)	(1)	0,00
	07.2023	CHF	626		699	0	0	0	0,00
	07.2023	€	44.525		48.786	209	0	209	0,00
	07.2023	$	77	€	70	0	0	0	0,00
	07.2023		1.020	¥	141.786	0	(39)	(39)	0,00
	07.2023		2	NZD	4	0	0	0	0,00
	08.2023		190	AUD	287	1	0	1	0,00
	08.2023		699	CHF	624	0	0	0	0,00
	08.2023		48.832	€	44.505	0	(211)	(211)	0,00
CBK	07.2023	€	52	$	57	0	0	0	0,00
	07.2023	$	604	€	562	10	0	10	0,00
IND	07.2023	CHF	16	$	18	0	0	0	0,00
	08.2023	$	18	CHF	16	0	0	0	0,00
JPM	07.2023	¥	48.265	$	337	3	0	3	0,00
	08.2023	$	337	¥	48.060	0	(4)	(4)	0,00
MBC	07.2023	€	145	$	156	0	(2)	(2)	0,00
	07.2023	£	157		196	0	(4)	(4)	0,00
	07.2023	$	3	CAD	3	0	0	0	0,00
	07.2023		217	€	199	2	(1)	1	0,00
	07.2023		8.147	£	6.582	220	0	220	0,00
MYI	07.2023		9	CHF	8	0	0	0	0,00
	07.2023		60	SEK	648	0	0	0	0,00
SCX	07.2023	AUD	589	$	391	0	(1)	(1)	0,00
	07.2023	$	678	CHF	610	3	0	3	0,00
	07.2023		71	NZD	116	1	0	1	0,00
	08.2023		391	AUD	589	1	0	1	0,00
SOG	07.2023		787		1.203	14	0	14	0,00
	07.2023		47.357	€	44.023	672	0	672	0,01
TOR	07.2023	AUD	725	$	479	0	(4)	(4)	0,00
	07.2023	CAD	4.733		3.566	0	(11)	(11)	0,00
	07.2023	£	6.425		8.164	0	(4)	(4)	0,00
	07.2023	NZD	165		100	0	(1)	(1)	0,00
	07.2023	$	416	AUD	637	7	0	7	0,00
	08.2023		479		725	4	0	4	0,00
	08.2023		3.566	CAD	4.731	11	0	11	0,00
	08.2023		8.165	£	6.425	4	0	4	0,00
	08.2023		100	NZD	165	1	0	1	0,00
UAG	07.2023	AUD	395	$	261	0	(2)	(2)	0,00
	07.2023	$	95	AUD	146	2	0	2	0,00
	07.2023		44	CHF	40	0	0	0	0,00
	08.2023		261	AUD	395	2	0	2	0,00
						$ 1.313	$ (287)	$ 1.026	0,01

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklassen Institutional EUR (Hedged) thesaurierend, Institutional EUR (Hedged) ausschüttend, Investor EUR (Hedged) thesaurierend, Investor EUR (Hedged) ausschüttend, Administrative EUR (Hedged) thesaurierend, Administrative EUR (Hedged) ausschüttend, Class E EUR (Hedged) thesaurierend, Class E EUR (Hedged) ausschüttend, Class R EUR (Hedged) ausschüttend, Class T EUR (Hedged) thesaurierend, Class W EUR (Hedged) thesaurierend und Class W EUR (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung		Zu erhaltende Währung		Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2023	$	787.948	€	733.130	$ 11.902	$ (4)	$ 11.898	0,11
BPS	07.2023	€	725.158	$	794.516	3.380	(12)	3.368	0,03
	07.2023	$	792.262	€	736.861	11.671	(17)	11.654	0,11
	08.2023		789.286		719.338	0	(3.414)	(3.414)	(0,03)
CBK	07.2023	€	744.782	$	809.419	2	(3.140)	(3.138)	(0,03)
	07.2023	$	2.709	€	2.476	0	(7)	(7)	0,00
	08.2023		776.143		712.885	2.681	0	2.681	0,02
JPM	07.2023	€	720.167	$	786.351	648	0	648	0,01
	07.2023	$	33.791	€	31.605	690	0	690	0,01
	08.2023		787.450		720.167	0	(672)	(672)	(0,01)
MBC	07.2023	€	45.147	$	48.387	0	(868)	(868)	(0,01)
	07.2023	$	5.346	€	4.975	83	(2)	81	0,00
SOG	07.2023		785.082		729.807	11.138	0	11.138	0,11
						$ 42.195	$ (8.136)	$ 34.059	0,32

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklassen Institutional GBP (Hedged) thesaurierend, Institutional GBP (Hedged) ausschüttend, Investor GBP (Hedged) ausschüttend, Administrative GBP (Hedged) ausschüttend, E Class GBP (Hedged) ausschüttend, R Class GBP (Hedged) ausschüttend, W Class GBP (Hedged) thesaurierend und W Class GBP (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung		Zu erhaltende Währung		Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2023	£	438	$	556	$ 0	$ (1)	$ (1)	0,00
	07.2023	$	127	£	101	1	0	1	0,00
BPS	07.2023		449.439		362.179	11.351	(333)	11.018	0,11
BRC	07.2023	£	2.759	$	3.482	1	(27)	(26)	0,00
	07.2023	$	1.772	£	1.423	38	0	38	0,00

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung		Zu erhaltende Währung		Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
CBK	07.2023	£	8.694	$	10.947	$ 8	$ (115)	$ (107)	0,00
	07.2023	$	332	£	263	3	0	3	0,00
JPM	07.2023	£	335.315	$	423.972	0	(2.332)	(2.332)	(0,02)
	08.2023	$	424.062	£	335.315	2.326	0	2.326	0,02
MBC	07.2023		403.500		325.955	10.903	(1)	10.902	0,10
MYI	07.2023		403.575		324.714	9.251	0	9.251	0,09
TOR	07.2023	£	335.832	$	426.741	0	(218)	(218)	0,00
	08.2023	$	426.834	£	335.832	211	0	211	0,00
						$ 34.093	$ (3.027)	$ 31.066	0,30

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklasse Institutional NOK (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung		Zu erhaltende Währung		Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2023	NOK	9	$	1	$ 0	$ 0	$ 0	0,00
	07.2023	$	9.141	NOK	100.865	274	0	274	0,00
BPS	07.2023	NOK	68.609	$	6.382	0	(22)	(22)	0,00
	08.2023	$	6.382	NOK	68.542	22	0	22	0,00
CBK	07.2023	NOK	3.596	$	324	0	(12)	(12)	0,00
	07.2023	$	7.814	NOK	87.875	388	0	388	0,01
GLM	07.2023	NOK	72.566	$	6.733	0	(41)	(41)	0,00
	08.2023	$	6.733	NOK	72.495	41	0	41	0,00
RYL	07.2023	NOK	85	$	8	0	0	0	0,00
UAG	07.2023	$	6.967	NOK	77.091	229	0	229	0,00
						$ 954	$ (75)	$ 879	0,01

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklassen Institutional SEK (Hedged) thesaurierend und Administrative SEK (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung		Zu erhaltende Währung		Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2023	SEK	1.368.269	$	126.957	$ 299	$ (19)	$ 280	0,00
	07.2023	$	33	SEK	349	0	0	0	0,00
	08.2023		93.646		1.009.361	0	(80)	(80)	0,00
BPS	07.2023	SEK	158.850	$	14.853	146	0	146	0,00
BRC	07.2023	$	1	SEK	6	0	0	0	0,00
CBK	07.2023		67.716		739.603	758	0	758	0,01
GLM	07.2023	SEK	78	$	7	0	0	0	0,00
	07.2023	$	75	SEK	812	0	0	0	0,00
MBC	07.2023	SEK	2.767	$	257	1	0	1	0,00
	07.2023	$	75.531	SEK	813.436	0	(222)	(222)	0,00
MYI	07.2023	SEK	1.011.051	$	93.646	41	0	41	0,00
	07.2023	$	108.693	SEK	1.166.772	0	(671)	(671)	(0,01)
	08.2023		93.646		1.009.796	0	(40)	(40)	0,00
SCX	07.2023	SEK	893	$	83	1	0	1	0,00
	07.2023	$	75.863	SEK	820.568	106	0	106	0,00
						$ 1.352	$ (1.032)	$ 320	0,00

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklassen Institutional SGD (Hedged) ausschüttend, Investor SGD (Hedged) ausschüttend, Administrative SGD (Hedged) ausschüttend, Class E SGD (Hedged) ausschüttend und Class W SGD (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung		Zu erhaltende Währung		Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BRC	07.2023	$	28.844	SGD	39.030	$ 0	$ (5)	$ (5)	0,00
GLM	07.2023	SGD	83	$	62	0	0	0	0,00
	07.2023	$	7.120	SGD	9.560	0	(56)	(56)	0,00
JPM	07.2023	SGD	42.389	$	31.325	3	0	3	0,00
	07.2023	$	3.692	SGD	4.997	0	0	0	0,00
	08.2023		31.325		42.348	0	(2)	(2)	0,00
MBC	07.2023		26.484		35.783	0	(43)	(43)	0,00
	08.2023	SGD	198	$	146	0	0	0	0,00
MYI	07.2023		41.538		30.739	48	(1)	47	0,00
	08.2023	$	30.021	SGD	40.527	0	(45)	(45)	0,00
UAG	07.2023	SGD	202	$	150	1	0	1	0,00
	07.2023	$	28.154	SGD	38.086	0	(12)	(12)	0,00
						$ 52	$ (164)	$ (112)	0,00

Summe Freiverkehrsfinanzderivate	**$ 46.620**	**0,44**
Summe Anlagen	**$ 10.785.911**	**102,79**
Sonstige Aktiva und Passiva	**$ (293.060)**	**(2,79)**
Nettovermögen	**$ 10.492.851**	**100,00**

ERLÄUTERUNGEN ZUR AUFSTELLUNG DES WERTPAPIERBESTANDS (Angaben in Tausend*):

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

^ **Das Wertpapier ist in Verzug.**

(a) **Bei dem Wertpapier handelt es sich um ein Interest Only- („IO“) bzw. IO-Strip.**

(b) **Wertpapier per Emissionstermin.**

(c) **Wertpapier mit Sachwertausschüttung.**

(d) **Das Wertpapier hat in den letzten zwölf Monaten keine Erträge geliefert.**

(e) **Nullkuponwertpapier.**

(f) **Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.**

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

(h) **Mit dem Fonds verbunden.**

(i) **Bedingt wandelbares Wertpapier.**

(i) **Eingeschränkte Wertpapiere (31. Dezember 2022: 0,70 %):**

Emittentenbeschreibung	Kupon	Fälligkeits-datum	Kauf-datum	Kosten	Markt-wert	% des Nettovermögens
Citigroup, Inc.	2,572 %	03.06.2031	26.05.2020 - 09.07.2020	$ 25.025	$ 20.619	0,20
Morgan Stanley	0,000	02.04.2032	11.02.2020	41.043	29.310	0,28
Oracle Corp.	4,100	25.03.2061	24.03.2021 - 26.03.2021	6.835	4.877	0,05
Oracle Corp.	6,250	09.11.2032	07.11.2022	14.476	15.398	0,15
				$ 87.379	$ 70.204	0,68

Barmittel in Höhe von 179.611 USD (31. Dezember 2022: 213.307 USD) wurden zum 30. Juni 2023 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Barmittel in Höhe von 590 USD (31. Dezember 2022: 55.028 USD) wurden zum 30. Juni 2023 gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. als Sicherheit für Finanzderivate verpfändet.

Wertpapiere mit einem gesamten beizulegenden Zeitwert von null USD (31. Dezember 2022: 4.048 USD) wurden zum 30. Juni 2023 gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen als Sicherheit für Pensionsgeschäfte verpfändet.

Beizulegender Zeitwert[1]

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 30. Juni 2023 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie[2]	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	$ 0	$ 9.173.458	$ 13.232	$ 9.186.690
Investmentfonds	1.057.482	0	0	1.057.482
Pensionsgeschäfte	0	559.532	0	559.532
Finanzderivate[3]	(7.125)	(10.668)	0	(17.793)
Summen	**$ 1.050.357**	**$ 9.722.322**	**$ 13.232**	**$ 10.785.911**

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

Kategorie[2]	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	$ 1	$ 9.770.167	$ 8.376	$ 9.778.544
Investmentfonds	782.040	256.286	0	1.038.326
Pensionsgeschäfte	0	75.423	0	75.423
Finanzderivate[3]	(44.604)	(36.888)	0	(81.492)
Leerverkaufte Wertpapiere	0	(136.255)	0	(136.255)
Summen	**$ 737.437**	**$ 9.928.733**	**$ 8.376**	**$ 10.674.546**

(1) Weitere Informationen finden Sie in den Erläuterungen in Erläuterung 3.

(2) Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung des Wertpapierbestands.

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

Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC-Derivate und -Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2023 und 31. Dezember 2022:

	Zum 30. Jun. 2023			Zum 31. Dez. 2022		
Kontrahent	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-engagement[1]	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-engagement[1]
AZD	$ (3)	$ 0	$ (3)	$ 32	$ 0	$ 32
BOA	8.777	(6.280)	2.497	5.200	(5.790)	(590)
BOM	k. A.	k. A.	k. A.	360	(470)	(110)
BPS	4.436	(840)	3.596	(21.024)	20.550	(474)
BRC	2.002	(2.040)	(38)	977	0	977
BSH	99	0	99	(11)	0	(11)
CBK	2.761	(2.470)	291	36.530	(37.360)	(830)
CLY	k. A.	k. A.	k. A.	24	0	24
DUB	819	(570)	249	(3.383)	3.210	(173)
FAR	(7)	0	(7)	k. A.	k. A.	k. A.
FBF	k. A.	k. A.	k. A.	189	(250)	(61)
GLM	1.980	(1.830)	150	(8.272)	8.408	136
GST	219	(210)	9	1.037	(1.030)	7
IND	(454)	510	56	k. A.	k. A.	k. A.
JLN	(341)	0	(341)	(237)	0	(237)
JPM	2.357	(2.020)	337	(9.156)	8.080	(1.076)
MBC	769	0	769	20.345	(19.090)	1.255
MYC	206	(260)	(54)	(594)	630	36
MYI	8.959	(5.090)	3.869	(342)	280	(62)
RBC	(89)	80	(9)	236	(350)	(114)
RYL	k. A.	k. A.	k. A.	14	0	14
SAL	(104)	0	(104)	(90)	0	(90)
SCX	772	0	772	(14.373)	13.840	(533)
SOG	11.647	(8.600)	3.047	(88)	30	(58)
SSB	(17)	0	(17)	k. A.	k. A.	k. A.
TOR	(102)	0	(102)	365	(2.890)	(2.525)
UAG	1.934	(640)	1.294	623	0	623

[1] Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären.

Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung des Wertpapierbestands zum 30. Juni 2023:

	30. Jun. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	62,92	63,86
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	24,62	28,59
Sonstige übertragbare Wertpapiere	0,01	0,33
Investmentfonds	10,08	9,85
Pensionsgeschäfte	5,33	0,72
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	(0,08)	(0,41)
Zentral abgerechnete Finanzderivate	(0,53)	(0,44)
Freiverkehrsfinanzderivate	0,44	0,08
Leerverkaufte Wertpapiere	k. A.	(1,29)
Umgekehrte Pensionsgeschäfte	k. A.	(0,04)

Das Anlageportfolio des Fonds konzentriert sich zum 30. Juni 2023 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	30. Jun. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
Australien	1,74	1,72
Österreich	0,19	0,21
Belgien	0,12	0,12
Bermuda	0,57	0,66
Brasilien	0,19	0,32
Kanada	2,40	2,14
Cayman-Inseln	2,42	3,29
Chile	0,02	0,06
China	0,16	0,27
Kolumbien	0,08	k. A.
Zypern	0,09	0,09
Tschechische Republik	0,05	k. A.
Dänemark	0,31	0,30
Finnland	0,21	0,20
Frankreich	2,54	2,51
Deutschland	1,56	1,98
Guernsey, Kanalinseln	0,34	0,33
Hongkong	0,12	0,27
Indien	0,21	0,25
Indonesien	0,17	0,17
Irland	0,69	0,78
Italien	1,82	2,62
Japan	2,00	1,59
Jersey, Kanalinseln	0,49	0,53
Luxemburg	1,04	2,33
Mauritius	0,09	0,37
Mexiko	0,16	0,18
Multinational	0,03	0,03

Anlagen zum Marktwert	30. Jun. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
Niederlande	2,86	2,56
Norwegen	0,19	0,13
Panama	k. A.	0,18
Peru	0,09	1,25
Polen	0,10	k. A.
Katar	0,10	0,10
Rumänien	0,35	0,31
Russland	0,00	0,02
Saudi-Arabien	0,94	0,16
Singapur	0,39	0,17
Slowakei	0,00	0,00
Slowenien	0,11	0,10
Südafrika	0,75	0,95
Südkorea	0,07	0,07
Spanien	0,19	0,25
Supranational	0,23	0,22
Schweden	0,20	0,32
Schweiz	1,83	2,23
Thailand	0,07	0,07
Türkei	0,04	0,04
Ukraine	k. A.	0,02
Vereinigte Arabische Emirate	0,08	0,08
Großbritannien	5,02	5,72
USA	51,94	51,20
Jungferninseln (Britisch)	0,40	0,40
Kurzfristige Instrumente	1,79	2,91
Investmentfonds	10,08	9,85
Pensionsgeschäfte	5,33	0,72
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	(0,08)	(0,41)
Verkaufsoptionen		
Optionen auf börsengehandelte Terminkontrakte	0,00	k. A.
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen - Schutzkauf	0,00	0,00
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	(0,01)	(0,07)
Credit Default Swaps auf Kreditindizes— Schutzverkauf	0,08	0,01
Zinsswaps	(0,60)	(0,38)
Freiverkehrsfinanzderivate		
Optionskauf		
Zinsswapoptionen	k. A.	0,45
Verkaufsoptionen		
Credit Default Swaptions auf Kreditindizes	k. A.	0,00
Zinsswapoptionen	(0,01)	(0,81)
Optionen auf Wertpapiere	0,00	0,00
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	0,02	0,03
Credit Default Swaps auf Kreditindizes— Schutzverkauf	0,04	0,05
Devisenterminkontrakte	(0,30)	(0,50)
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	0,69	0,86
Leerverkaufte Wertpapiere	k. A.	(1,29)
Sonstige Aktiva und Passiva	(2,79)	(1,29)
Nettovermögen	100,00	100,00

BESCHREIBUNG		PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE				
AUSTRALIEN				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
APPF Commercial Finance Pty. Ltd.				
3,600 % fällig am 11.11.2031	AUD	800	$ 418	0,02
Australia & New Zealand Banking Group Ltd.				
3,437 % fällig am 04.04.2025	€	2.000	2.162	0,12
Boral Finance Pty. Ltd.				
3,750 % fällig am 01.05.2028	$	52	46	0,00
Commonwealth Bank of Australia				
3,743 % fällig am 12.09.2039 (g)		200	151	0,01
GAIF Bond Issuer Pty. Ltd.				
3,400 % fällig am 30.09.2026		850	788	0,04
Goodman Australia Finance Pty. Ltd.				
1,375 % fällig am 27.09.2025	€	400	403	0,02
GPT Wholesale Office Fund				
3,222 % fällig am 05.11.2031	AUD	1.740	902	0,05
Lendlease Finance Ltd.				
3,400 % fällig am 27.10.2027		1.370	801	0,04
Macquarie University				
2,250 % fällig am 22.05.2030		750	411	0,02
3,500 % fällig am 07.09.2028		250	153	0,01
National Australia Bank Ltd.				
5,200 % fällig am 13.05.2025	$	3.800	3.793	0,21
Sydney Airport Finance Co. Pty. Ltd.				
3,375 % fällig am 30.04.2025		150	144	0,01
Transurban Finance Co. Pty. Ltd.				
2,450 % fällig am 16.03.2031		2.100	1.720	0,10
4,125 % fällig am 02.02.2026		600	578	0,03
Vicinity Centres Trust				
4,927 % fällig am 02.06.2028	AUD	2.500	1.605	0,09
Worley Financial Services Pty. Ltd.				
5,950 % fällig am 13.10.2028		1.700	1.095	0,06
			15.170	0,83
STAATSEMISSIONEN				
Australia Government International Bond				
4,250 % fällig am 21.04.2026		525	351	0,02
Summe Australien			15.521	0,85
ÖSTERREICH				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Erste Group Bank AG				
0,125 % fällig am 17.05.2028	€	1.400	1.262	0,07
4,000 % fällig am 16.01.2031		1.000	1.073	0,06
4,250 % fällig am 15.10.2027 (f)(g)		2.400	1.997	0,11
6,500 % fällig am 15.04.2024 (f)(g)		200	212	0,01
UniCredit Bank Austria AG				
3,125 % fällig am 21.09.2029		2.800	3.010	0,17
Summe Österreich			7.554	0,42
BELGIEN				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
ING Belgium S.A.				
3,375 % fällig am 31.05.2027		5.000	5.416	0,30
KBC Group NV				
1,500 % fällig am 29.03.2026		500	518	0,03
4,375 % fällig am 06.12.2031		4.000	4.346	0,24
5,796 % fällig am 19.01.2029	$	400	398	0,02
Silfin NV				
2,875 % fällig am 11.04.2027	€	2.400	2.356	0,13
Sofina S.A.				
1,000 % fällig am 23.09.2028		1.200	1.048	0,05
			14.082	0,77
STAATSEMISSIONEN				
Belgium Government International Bond				
2,750 % fällig am 22.04.2039		700	714	0,04
Communaute Francaise de Belgique				
0,625 % fällig am 11.06.2035		2.000	1.565	0,09
Ministeries van de Vlaamse Gemeenschap				
1,500 % fällig am 11.04.2044		300	229	0,01
3,250 % fällig am 12.01.2043		2.100	2.174	0,12
Region Wallonne Belgium				
3,500 % fällig am 15.03.2043	€	5.800	$ 6.137	0,34
			10.819	0,60
Summe Belgien			24.901	1,37
KANADA				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Bank of Montreal				
1,758 % fällig am 10.03.2026	CAD	2.900	1.999	0,11
5,440 % fällig am 08.12.2023	$	900	900	0,05
Bank of Nova Scotia				
4,900 % fällig am 04.06.2025 (f)(g)		3.000	2.840	0,16
5,447 % fällig am 31.07.2024		500	498	0,03
Brookfield Finance, Inc.				
2,724 % fällig am 15.04.2031		4.850	3.977	0,22
Brookfield Property Finance ULC				
7,125 % fällig am 13.02.2028 (h)	CAD	1.100	770	0,04
Canadian Imperial Bank of Commerce				
4,414 % fällig am 08.06.2028	$	3.100	3.044	0,17
5,062 % fällig am 13.04.2026	£	3.000	3.818	0,21
CGI, Inc.				
2,300 % fällig am 14.09.2031	$	1.000	785	0,04
Manulife Financial Corp.				
3,703 % fällig am 16.03.2032		1.000	910	0,05
Open Text Corp.				
6,900 % fällig am 01.12.2027		1.400	1.427	0,08
Toronto-Dominion Bank				
1,952 % fällig am 08.04.2030	€	3.700	3.513	0,19
4,701 % fällig am 05.06.2027	$	2.400	2.375	0,13
			26.856	1,48
STAATSEMISSIONEN				
Canada Government International Bond				
2,250 % fällig am 01.12.2029	CAD	12.200	8.618	0,47
Province of Quebec				
1,850 % fällig am 13.02.2027		500	349	0,02
			8.967	0,49
Summe Kanada			35.823	1,97
CAYMAN INSELN				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Goodman HK Finance				
4,375 % fällig am 19.06.2024	$	300	295	0,02
Health & Happiness International Holdings Ltd.				
5,625 % fällig am 24.10.2024		1.200	1.107	0,06
MAF Sukuk Ltd.				
3,933 % fällig am 28.02.2030		400	375	0,02
Summe Cayman Inseln			1.777	0,10
CHILE				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Banco de Credito e Inversiones S.A.				
2,875 % fällig am 14.10.2031		3.100	2.571	0,14
STAATSEMISSIONEN				
Chile Government International Bond				
1,250 % fällig am 29.01.2040	€	800	582	0,03
1,250 % fällig am 22.01.2051		2.200	1.261	0,07
3,500 % fällig am 25.01.2050	$	300	226	0,01
3,500 % fällig am 15.04.2053		1.600	1.196	0,07
4,340 % fällig am 07.03.2042		1.000	890	0,05
			4.155	0,23
Summe Chile			6.726	0,37
TSCHECHISCHE REPUBLIK				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
UniCredit Bank Czech Republic & Slovakia A/S				
3,750 % fällig am 20.06.2028	€	4.100	4.427	0,24
DÄNEMARK				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
GN Store Nord A/S				
0,875 % fällig am 25.11.2024		1.400	1.425	0,08
Nykredit Realkredit A/S				
1,375 % fällig am 12.07.2027	€	1.650	$ 1.607	0,09
Orsted A/S				
5,125 % fällig am 13.09.2034	£	1.300	1.544	0,08
Pandora A/S				
4,500 % fällig am 10.04.2028	€	1.500	1.633	0,09
TDC Net A/S				
5,056 % fällig am 31.05.2028		5.200	5.577	0,30
5,618 % fällig am 06.02.2030		1.000	1.072	0,06
6,500 % fällig am 01.06.2031		2.800	3.055	0,17
Summe Dänemark			15.913	0,87
FINNLAND				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Balder Finland Oyj				
1,000 % fällig am 20.01.2029		400	279	0,02
Kemira Oyj				
1,000 % fällig am 30.03.2028		1.000	918	0,05
Nokia Oyj				
4,375 % fällig am 21.08.2031		2.800	3.013	0,17
Nordea Bank Abp				
1,500 % fällig am 30.09.2026	$	1.500	1.312	0,07
3,750 % fällig am 01.03.2029 (f)(g)		3.300	2.450	0,13
4,125 % fällig am 05.05.2028	€	2.500	2.703	0,15
6,000 % fällig am 02.06.2026	£	300	375	0,02
Tornator Oyj				
1,250 % fällig am 14.10.2026	€	200	197	0,01
			11.247	0,62
STAATSEMISSIONEN				
Kundarahoitus Oyj				
3,000 % fällig am 25.09.2028		2.200	2.379	0,13
Summe Finnland			13.626	0,75
FRANKREICH				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Accor S.A.				
2,375 % fällig am 29.11.2028		2.500	2.455	0,13
Altarea S.C.A.				
1,875 % fällig am 17.01.2028		1.200	1.059	0,06
Arkea Home Loans SFH S.A.				
3,250 % fällig am 01.08.2033		9.900	10.724	0,59
AXA S.A.				
1,375 % fällig am 07.10.2041		500	415	0,02
5,500 % fällig am 11.07.2043		2.500	2.732	0,15
Banque Federative du Credit Mutuel S.A.				
0,250 % fällig am 29.06.2028		900	821	0,05
1,750 % fällig am 19.12.2024	£	100	119	0,01
3,750 % fällig am 20.07.2023	$	3.670	3.667	0,20
4,000 % fällig am 21.11.2029	€	2.000	2.176	0,12
4,375 % fällig am 02.05.2030		1.100	1.192	0,07
BNP Paribas Home Loan SFH S.A.				
3,000 % fällig am 31.01.2030		1.500	1.607	0,09
BNP Paribas S.A.				
1,675 % fällig am 30.06.2027	$	6.650	5.867	0,32
2,219 % fällig am 09.06.2026		1.200	1.110	0,06
2,819 % fällig am 19.11.2025		1.300	1.240	0,07
3,132 % fällig am 20.01.2033		2.800	2.300	0,13
4,625 % fällig am 25.02.2031 (f)(g)		2.100	1.504	0,08
BPCE S.A.				
2,045 % fällig am 19.10.2027		4.000	3.491	0,19
3,116 % fällig am 19.10.2032		300	232	0,01
Cie de Financement Foncier S.A.				
3,125 % fällig am 17.05.2029	€	4.200	4.505	0,25
CNP Assurances				
1,250 % fällig am 27.01.2029		2.200	1.988	0,11
4,875 % fällig am 07.10.2030 (f)(g)	$	800	598	0,03
Credit Agricole Assurances S.A.				
1,500 % fällig am 06.10.2031	€	3.400	2.816	0,15
Credit Agricole S.A.				
0,125 % fällig am 09.12.2027		700	645	0,04
0,375 % fällig am 21.10.2025		400	402	0,02
5,301 % fällig am 12.07.2028	$	1.700	1.695	0,09
Danone S.A.				
2,589 % fällig am 02.11.2023		2.300	2.276	0,13

BESCHREIBUNG		PAR (000S)		MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
Electricite de France S.A.					
4,625 % fällig am 25.01.2043	€	1.100	$	1.152	0,06
5,500 % fällig am 25.01.2035	£	300		341	0,02
6,250 % fällig am 23.05.2033	$	1.000		1.017	0,06
6,900 % fällig am 23.05.2053		1.300		1.349	0,07
9,125 % fällig am 15.03.2033 (f)		1.300		1.336	0,07
Engie S.A.					
3,625 % fällig am 11.01.2030	€	1.000		1.081	0,06
4,000 % fällig am 11.01.2035		2.000		2.177	0,12
4,250 % fällig am 11.01.2043		1.200		1.320	0,07
Groupe des Assurances du Credit Mutuel					
1,850 % fällig am 21.04.2042		600		481	0,03
Holding d'Infrastructures de Transport SASU					
1,475 % fällig am 18.01.2031		3.000		2.675	0,15
Holding d'Infrastructures des Metiers de l'Environnement					
0,125 % fällig am 16.09.2025		3.500		3.449	0,19
JCDecaux SE					
1,625 % fällig am 07.02.2030		2.900		2.596	0,14
L'Oreal S.A.					
0,875 % fällig am 29.06.2026		2.300		2.329	0,13
New Immo Holding S.A.					
2,750 % fällig am 26.11.2026		900		881	0,05
SEB S.A.					
1,500 % fällig am 31.05.2024		200		213	0,01
Societe Generale S.A.					
0,500 % fällig am 12.06.2029		400		355	0,02
2,625 % fällig am 22.01.2025	$	200		188	0,01
3,625 % fällig am 01.03.2041		1.050		683	0,04
4,000 % fällig am 12.01.2027		2.200		2.053	0,11
6,096 % fällig am 21.01.2026		1.500		1.486	0,08
6,691 % fällig am 10.01.2034		3.100		3.158	0,17
7,367 % fällig am 10.01.2053		2.500		2.441	0,13
7,875 % fällig am 18.12.2023 (f)(g)		200		196	0,01
Suez SACA					
5,000 % fällig am 03.11.2032	€	1.200		1.391	0,08
Vilmorin & Cie S.A.					
1,375 % fällig am 26.03.2028		1.200		1.028	0,06
				93.012	5,11
STAATSEMISSIONEN					
Action Logement Services					
1,375 % fällig am 13.04.2032		2.500		2.327	0,13
3,125 % fällig am 28.09.2037		400		413	0,02
3,625 % fällig am 25.05.2043		5.000		5.386	0,30
Agence Francaise de Developpement					
1,625 % fällig am 25.05.2032		2.000		1.912	0,11
Caisse d'Amortissement de la Dette Sociale					
1,375 % fällig am 20.01.2031	$	4.000		3.256	0,18
2,750 % fällig am 25.11.2032	€	1.000		1.060	0,06
3,000 % fällig am 25.05.2028		1.200		1.298	0,07
France Government International Bond					
0,500 % fällig am 25.06.2044		2.100		1.358	0,07
2,000 % fällig am 25.11.2032		950		961	0,05
Region of Ile de France					
0,675 % fällig am 24.11.2036		1.900		1.461	0,08
3,050 % fällig am 03.02.2033		4.000		4.291	0,24
3,700 % fällig am 14.06.2038		3.900		4.335	0,24
SNCF Reseau					
0,750 % fällig am 25.05.2036		500		394	0,02
Societe Du Grand Paris EPIC					
3,500 % fällig am 25.05.2043		2.200		2.338	0,13
3,700 % fällig am 25.05.2053		2.000		2.193	0,12
Societe Nationale SNCF S.A.					
3,125 % fällig am 02.11.2027		5.600		6.024	0,33
3,375 % fällig am 25.05.2033		4.100		4.480	0,25
UNEDIC ASSEO					
0,000 % fällig am 19.11.2030 (d)		300		262	0,01
0,250 % fällig am 16.07.2035		1.000		774	0,04
				44.523	2,45
Summe Frankreich				137.535	7,56

BESCHREIBUNG		PAR (000S)		MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
DEUTSCHLAND					
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL					
Commerzbank AG					
3,125 % fällig am 13.06.2033		2.400		2.598	0,14
Deutsche Bahn Finance GmbH					
0,625 % fällig am 08.12.2050	€	750	$	414	0,02
Deutsche Bank AG					
1,447 % fällig am 01.04.2025 (h)	$	2.000		1.901	0,11
1,875 % fällig am 23.02.2028	€	2.500		2.417	0,13
2,222 % fällig am 18.09.2024	$	100		99	0,01
2,311 % fällig am 16.11.2027		3.000		2.580	0,14
2,552 % fällig am 07.01.2028		1.600		1.389	0,08
3,125 % fällig am 19.05.2033	€	1.300		1.411	0,08
3,547 % fällig am 18.09.2031	$	450		374	0,02
3,742 % fällig am 07.01.2033		1.300		954	0,05
3,961 % fällig am 26.11.2025		500		477	0,03
E.ON SE					
3,875 % fällig am 12.01.2035	€	1.000		1.085	0,06
Eurogrid GmbH					
3,279 % fällig am 05.09.2031		1.000		1.059	0,06
Fraport AG Frankfurt Airport Services Worldwide					
1,625 % fällig am 09.07.2024		300		319	0,02
2,125 % fällig am 09.07.2027		400		401	0,02
IHO Verwaltungs GmbH (3,750 % bar oder 4,500 % PIK)					
3,750 % fällig am 15.09.2026 (c)		300		306	0,02
Kreditanstalt fuer Wiederaufbau					
0,000 % fällig am 15.09.2028 (d)		7.450		6.950	0,38
0,750 % fällig am 30.09.2030	$	1.100		875	0,05
1,375 % fällig am 07.06.2032	€	1.300		1.248	0,07
2,750 % fällig am 14.02.2033		750		806	0,04
Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG in Muenchen					
1,000 % fällig am 26.05.2042		1.700		1.341	0,07
Robert Bosch GmbH					
4,375 % fällig am 02.06.2043		1.000		1.120	0,06
Vonovia SE					
0,000 % fällig am 01.12.2025 (d)		200		193	0,01
0,250 % fällig am 01.09.2028		1.900		1.614	0,09
1,375 % fällig am 28.01.2026		2.600		2.591	0,14
1,625 % fällig am 01.09.2051		100		53	0,00
1,875 % fällig am 28.06.2028		1.900		1.765	0,10
2,375 % fällig am 25.03.2032		400		356	0,02
ZF Finance GmbH					
2,000 % fällig am 06.05.2027		500		476	0,03
2,250 % fällig am 03.05.2028		1.800		1.659	0,09
				38.831	2,14
STAATSEMISSIONEN					
Land Berlin					
2,750 % fällig am 14.02.2033		2.600		2.783	0,15
Bundesrepublik Deutschland					
0,000 % fällig am 15.08.2031 (d)		14.700		13.288	0,73
4,750 % fällig am 04.07.2028		2.000		2.407	0,13
Land Hessen					
2,875 % fällig am 04.07.2033 (b)		1.200		1.297	0,07
Land Nordrhein-Westfalen					
0,500 % fällig am 25.11.2039		200		144	0,01
2,900 % fällig am 07.06.2033		1.975		2.138	0,12
				22.057	1,21
Summe Deutschland				60.888	3,35
GUERNSEY, KANALINSELN					
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL					
Globalworth Real Estate Investments Ltd.					
2,950 % fällig am 29.07.2026		1.850		1.522	0,08
Sirius Real Estate Ltd.					
1,125 % fällig am 22.06.2026		1.100		992	0,06
1,750 % fällig am 24.11.2028		2.300		1.792	0,10
Summe Guernsey, Kanalinseln				4.306	0,24

BESCHREIBUNG		PAR (000S)		MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
HONGKONG					
STAATSEMISSIONEN					
Hong Kong Government International Bond					
2,375 % fällig am 02.02.2051	$	300		204	0,01
3,750 % fällig am 07.06.2032	€	3.500		3.846	0,21
5,250 % fällig am 11.01.2053	$	3.200		3.580	0,20
Summe Hongkong				7.630	0,42
INDIEN					
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL					
Bharti Airtel Ltd.					
4,375 % fällig am 10.06.2025	$	1.200	$	1.167	0,06
Indian Railway Finance Corp. Ltd.					
3,570 % fällig am 21.01.2032		5.100		4.451	0,24
JSW Hydro Energy Ltd.					
4,125 % fällig am 18.05.2031		3.612		3.051	0,17
ReNew Power Pvt Ltd.					
5,875 % fällig am 05.03.2027		928		870	0,05
ReNew Wind Energy AP2					
4,500 % fällig am 14.07.2028		3.000		2.559	0,14
Summe Indien				12.098	0,66
INDONESIEN					
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL					
Bank Mandiri Persero Tbk PT					
2,000 % fällig am 19.04.2026		800		724	0,04
IRLAND					
FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE					
OCP Euro CLO DAC					
4,713 % fällig am 20.01.2033		2.000		2.179	0,12
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL					
Abbott Ireland Financing DAC					
0,100 % fällig am 19.11.2024		1.600		1.656	0,09
AIB Group PLC					
2,250 % fällig am 04.04.2028		2.800		2.773	0,15
4,625 % fällig am 23.07.2029		2.700		2.895	0,16
5,750 % fällig am 16.02.2029		2.000		2.250	0,12
Bank of Ireland Group PLC					
4,875 % fällig am 16.07.2028		1.500		1.636	0,09
6,253 % fällig am 16.09.2026	$	250		248	0,01
7,594 % fällig am 06.12.2032	£	3.000		3.653	0,20
CCEP Finance Ireland DAC					
0,500 % fällig am 06.09.2029	€	1.900		1.712	0,10
Shire Acquisitions Investments Ireland DAC					
2,875 % fällig am 23.09.2023	$	933		927	0,05
Smurfit Kappa Acquisitions ULC					
2,875 % fällig am 15.01.2026	€	300		316	0,02
				18.066	0,99
Summe Irland				20.245	1,11
ISRAEL					
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL					
Israel Discount Bank Ltd.					
5,375 % fällig am 26.01.2028	$	1.900		1.879	0,10
ITALIEN					
FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE					
Koromo Italy SRL					
4,213 % fällig am 26.02.2035	€	1.989		2.175	0,12
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL					
Intesa Sanpaolo SpA					
2,625 % fällig am 11.03.2036	£	1.000		832	0,05
3,625 % fällig am 30.06.2028	€	1.400		1.518	0,08
3,875 % fällig am 12.01.2028	$	1.400		1.251	0,07
4,000 % fällig am 23.09.2029		1.300		1.131	0,06
4,198 % fällig am 01.06.2032		900		672	0,04
4,950 % fällig am 01.06.2042		2.100		1.385	0,08
5,017 % fällig am 26.06.2024		4.600		4.457	0,25
6,625 % fällig am 31.05.2033	£	900		1.099	0,06
6,625 % fällig am 20.06.2033	$	800		798	0,04
7,778 % fällig am 20.06.2054		400		399	0,02
Mundys SpA					
1,875 % fällig am 12.02.2028	€	2.900		2.705	0,15
Nexi SpA					
2,125 % fällig am 30.04.2029		1.600		1.459	0,08
Snam SpA					
0,750 % fällig am 20.06.2029		500		452	0,02

BESCHREIBUNG		PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
UniCredit SpA				
1,982 % fällig am 03.06.2027	$	1.900	$ 1.675	0,09
3,500 % fällig am 31.07.2030	€	2.500	2.698	0,15
4,625 % fällig am 12.04.2027	$	1.000	951	0,05
5,459 % fällig am 30.06.2035		1.300	1.104	0,06
7,296 % fällig am 02.04.2034		3.400	3.206	0,18
			27.792	1,53
Summe Italien			29.967	1,65
JAPAN				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Central Japan Railway Co.				
3,400 % fällig am 06.09.2023		500	498	0,03
Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc.				
0,337 % fällig am 08.06.2027	€	900	873	0,05
0,339 % fällig am 19.07.2024		200	210	0,01
0,962 % fällig am 11.10.2025	$	400	373	0,02
0,980 % fällig am 09.10.2023	€	300	325	0,02
1,538 % fällig am 20.07.2027	$	1.650	1.457	0,08
1,640 % fällig am 13.10.2027		300	264	0,01
2,048 % fällig am 17.07.2030		700	568	0,03
2,341 % fällig am 19.01.2028		900	806	0,04
2,494 % fällig am 13.10.2032		2.900	2.334	0,13
2,757 % fällig am 13.09.2026		3.932	3.601	0,20
3,273 % fällig am 19.09.2025	€	2.000	2.150	0,12
3,837 % fällig am 17.04.2026	$	1.400	1.347	0,07
5,475 % fällig am 22.02.2031		200	199	0,01
Mizuho Financial Group, Inc.				
0,184 % fällig am 13.04.2026	€	600	586	0,03
1,020 % fällig am 11.10.2023		100	108	0,01
1,241 % fällig am 10.07.2024	$	800	800	0,04
2,201 % fällig am 10.07.2031		2.900	2.324	0,13
2,839 % fällig am 13.09.2026		8.261	7.574	0,42
3,170 % fällig am 11.09.2027		1.850	1.697	0,09
3,261 % fällig am 22.05.2030		4.800	4.240	0,23
6,123 % fällig am 08.09.2024		550	550	0,03
Nippon Life Insurance Co.				
2,900 % fällig am 16.09.2051		700	572	0,03
Nomura Holdings, Inc.				
2,172 % fällig am 14.07.2028		4.100	3.463	0,19
2,329 % fällig am 22.01.2027		3.900	3.451	0,19
Norinchukin Bank				
1,284 % fällig am 22.09.2026		2.000	1.754	0,10
2,080 % fällig am 22.09.2031		800	644	0,04
NTT Finance Corp.				
4,142 % fällig am 26.07.2024		2.900	2.855	0,16
4,239 % fällig am 25.07.2025		300	292	0,02
4,372 % fällig am 27.07.2027		800	783	0,04
ORIX Corp.				
1,919 % fällig am 20.04.2026	€	3.000	3.077	0,17
Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc.				
0,465 % fällig am 30.05.2024		300	317	0,02
0,819 % fällig am 23.07.2023		900	980	0,05
2,130 % fällig am 08.07.2030	$	2.300	1.874	0,10
2,348 % fällig am 15.01.2025		3.000	2.846	0,16
2,472 % fällig am 14.01.2029		4.800	4.098	0,22
3,010 % fällig am 19.10.2026		1.395	1.290	0,07
3,202 % fällig am 17.09.2029 (g)		400	349	0,02
6,125 % fällig am 19.07.2023		100	100	0,01
Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd.				
1,350 % fällig am 16.09.2026		2.500	2.195	0,12
2,800 % fällig am 10.03.2027		1.200	1.104	0,06
3,629 % fällig am 06.04.2026	€	3.500	3.772	0,21
			68.700	3,78
STAATSEMISSIONEN				
Japan Finance Organization for Municipalities				
3,375 % fällig am 22.02.2028		2.100	2.270	0,12
Summe Japan			70.970	3,90
JERSEY, KANALINSELN				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Aptiv PLC				
3,100 % fällig am 01.12.2051	$	1.800	1.133	0,06
LUXEMBURG				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Acef Holding S.C.A.				
0,750 % fällig am 14.06.2028	€	1.700	$ 1.519	0,08
1,250 % fällig am 26.04.2030		2.650	2.216	0,12
CBRE Global Investors Open-Ended Fund S.C.A. SICAV-SIF Pan European Core Fund				
0,500 % fällig am 27.01.2028		600	518	0,03
0,900 % fällig am 12.10.2029		3.700	2.956	0,16
CPI Property Group S.A.				
1,500 % fällig am 27.01.2031		500	297	0,02
1,625 % fällig am 23.04.2027		700	558	0,03
1,750 % fällig am 14.01.2030		3.050	2.020	0,11
2,750 % fällig am 12.05.2026		1.062	943	0,05
2,750 % fällig am 22.01.2028	£	350	298	0,02
Logicor Financing SARL				
1,625 % fällig am 17.01.2030	€	500	404	0,02
2,000 % fällig am 17.01.2034		2.900	2.105	0,12
Segro Capital SARL				
1,875 % fällig am 23.03.2030		950	871	0,05
SELP Finance SARL				
0,875 % fällig am 27.05.2029		1.950	1.664	0,09
			16.369	0,90
STAATSEMISSIONEN				
Großherzogtum Luxemburg				
0,000 % fällig am 14.09.2032 (d)		2.000	1.668	0,09
Summe Luxemburg			18.037	0,99
MAURITIUS				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
India Green Energy Holdings				
5,375 % fällig am 29.04.2024	$	3.550	3.471	0,19
India Green Power Holdings				
4,000 % fällig am 22.02.2027		1.200	1.050	0,06
Summe Mauritius			4.521	0,25
MEXIKO				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Banco Mercantil del Norte S.A.				
6,625 % fällig am 24.01.2032 (f)(g)		1.800	1.393	0,08
Metalsa S.A. de C.V.				
3,750 % fällig am 04.05.2031		2.900	2.286	0,12
			3.679	0,20
STAATSEMISSIONEN				
Mexico Government International Bond				
6,338 % fällig am 04.05.2053		2.000	2.042	0,11
Summe Mexiko			5.721	0,31
MULTINATIONAL				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
NXP BV				
2,500 % fällig am 11.05.2031		2.660	2.169	0,12
3,875 % fällig am 18.06.2026		150	144	0,01
5,000 % fällig am 15.01.2033		6.500	6.245	0,34
Summe multinational			8.558	0,47
NIEDERLANDE				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
ABB Finance BV				
3,250 % fällig am 16.01.2027	€	800	859	0,05
ABN AMRO Bank NV				
2,470 % fällig am 13.12.2029	$	7.800	6.538	0,36
4,000 % fällig am 16.01.2028	€	400	428	0,02
4,750 % fällig am 28.07.2025	$	1.500	1.448	0,08
5,250 % fällig am 26.05.2026	£	2.000	2.462	0,14
Achmea Bank NV				
3,000 % fällig am 31.01.2030	€	2.100	2.245	0,12
Akzo Nobel NV				
2,000 % fällig am 28.03.2032		750	698	0,04
Arcadis NV				
4,875 % fällig am 28.02.2028		1.900	2.073	0,11
CNH Industrial NV				
4,500 % fällig am 15.08.2023	$	1.650	$ 1.647	0,09
Compass Group Finance Netherlands BV				
3,000 % fällig am 08.03.2030	€	1.700	1.771	0,10
Cooperatieve Rabobank UA				
1,004 % fällig am 24.09.2026	$	3.500	3.128	0,17
1,106 % fällig am 24.02.2027		800	708	0,04
3,649 % fällig am 06.04.2028		3.400	3.151	0,17
4,375 % fällig am 29.06.2027 (f)(g)	€	1.000	955	0,05
4,875 % fällig am 29.06.2029 (f)(g)		2.800	2.572	0,14
5,250 % fällig am 14.09.2027	£	1.200	1.418	0,08
CTP NV				
0,500 % fällig am 21.06.2025	€	3.800	3.696	0,20
0,875 % fällig am 20.01.2026		2.900	2.702	0,15
1,250 % fällig am 21.06.2029		500	396	0,02
1,500 % fällig am 27.09.2031		2.500	1.904	0,10
Digital Dutch Finco BV				
1,000 % fällig am 15.01.2032		350	270	0,01
1,250 % fällig am 01.02.2031		1.900	1.550	0,09
Digital Intrepid Holding BV				
0,625 % fällig am 15.07.2031		1.600	1.215	0,07
1,375 % fällig am 18.07.2032		1.000	782	0,04
Enel Finance International NV				
1,875 % fällig am 12.07.2028	$	1.700	1.427	0,08
2,250 % fällig am 12.07.2031		2.300	1.804	0,10
2,650 % fällig am 10.09.2024		200	193	0,01
2,875 % fällig am 11.04.2029	£	3.100	3.275	0,18
4,250 % fällig am 15.06.2025	$	1.900	1.845	0,10
7,750 % fällig am 14.10.2052		2.000	2.346	0,13
Holcim Sterling Finance Netherlands BV				
2,250 % fällig am 04.04.2034	£	1.800	1.580	0,09
Iberdrola International BV				
6,750 % fällig am 15.09.2033	$	1.200	1.271	0,07
ING Groep NV				
1,250 % fällig am 16.02.2027	€	1.200	1.199	0,07
1,400 % fällig am 01.07.2026	$	1.800	1.640	0,09
1,726 % fällig am 01.04.2027		1.900	1.694	0,09
2,125 % fällig am 23.05.2026	€	2.700	2.810	0,15
3,875 % fällig am 16.05.2027 (f)(g)	$	200	143	0,01
4,125 % fällig am 24.08.2033	€	2.100	2.162	0,12
4,250 % fällig am 16.05.2031 (f)(g)	$	1.000	668	0,04
6,500 % fällig am 16.04.2025 (f)(g)		300	280	0,02
JAB Holdings BV				
4,500 % fällig am 08.04.2052		4.100	3.171	0,17
5,000 % fällig am 12.06.2033	€	200	222	0,01
JDE Peet's NV				
1,125 % fällig am 16.06.2033		300	246	0,01
2,250 % fällig am 24.09.2031	$	1.000	775	0,04
LeasePlan Corp. NV				
0,250 % fällig am 07.09.2026	€	3.500	3.361	0,18
1,375 % fällig am 07.03.2024		800	855	0,05
Mondelez International Holdings Netherlands BV				
0,250 % fällig am 09.09.2029		2.000	1.778	0,10
Nationale-Nederlanden Bank NV				
0,500 % fällig am 21.09.2028		3.200	2.894	0,16
1,875 % fällig am 17.05.2032		500	489	0,03
3,250 % fällig am 28.05.2027		2.000	2.163	0,12
NE Property BV				
2,000 % fällig am 20.01.2030		4.200	3.391	0,19
3,375 % fällig am 14.07.2027		600	588	0,03
NN Group NV				
4,500 % fällig am 15.01.2026 (f)		200	211	0,01
4,625 % fällig am 13.01.2048		200	211	0,01
Prosus NV				
2,085 % fällig am 19.01.2030		1.300	1.112	0,06
2,778 % fällig am 19.01.2034		200	161	0,01
3,257 % fällig am 19.01.2027	$	2.200	1.989	0,11
Siemens Energy Finance BV				
4,000 % fällig am 05.04.2026	€	2.500	2.668	0,15
Sika Capital BV				
3,750 % fällig am 03.11.2026		2.000	2.169	0,12
Stedin Holding NV				
0,500 % fällig am 14.11.2029		100	90	0,00
Telefonica Europe BV				
6,135 % fällig am 03.02.2030 (f)		2.500	2.638	0,15
TenneT Holding BV				
4,250 % fällig am 28.04.2032		1.000	1.145	0,06

BESCHREIBUNG		PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
Thermo Fisher Scientific Finance BV				
1,625 % fällig am 18.10.2041	€	700	$ 526	0,03
Universal Music Group NV				
4,000 % fällig am 13.06.2031		600	653	0,04
Van Lanschot Kempen NV				
3,500 % fällig am 31.05.2026		1.000	1.082	0,06
Vesteda Finance BV				
0,750 % fällig am 18.10.2031		5.300	4.378	0,24
Vonovia Finance BV				
0,500 % fällig am 14.09.2029		100	82	0,00
1,125 % fällig am 14.09.2034		200	142	0,01
Wabtec Transportation Netherlands BV				
1,250 % fällig am 03.12.2027		4.200	3.983	0,22
WPC Eurobond BV				
1,350 % fällig am 15.04.2028		300	278	0,02
			112.404	6,18
NON-AGENCY-MBS				
Green Storm BV				
4,138 % fällig am 22.02.2068		200	220	0,01
STAATSEMISSIONEN				
BNG Bank NV				
0,050 % fällig am 20.11.2029		700	628	0,03
0,500 % fällig am 26.11.2025		500	508	0,03
3,000 % fällig am 11.01.2033		5.000	5.403	0,30
3,500 % fällig am 19.05.2028	$	1.600	1.540	0,08
Nederlandse Waterschapsbank NV				
0,125 % fällig am 03.09.2035	€	2.000	1.517	0,08
2,750 % fällig am 17.12.2029		500	532	0,03
3,000 % fällig am 20.04.2033		6.500	7.036	0,39
			17.164	0,94
Summe Niederlande			129.788	7,13
NORWEGEN				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
DNB Bank ASA				
0,375 % fällig am 18.01.2028		2.400	2.302	0,13
PERU				
STAATSEMISSIONEN				
Peru Government International Bond				
1,950 % fällig am 17.11.2036		2.000	1.583	0,09
PHILIPPINEN				
STAATSEMISSIONEN				
Philippines Government International Bond				
5,500 % fällig am 17.01.2048	$	3.900	4.007	0,22
POLEN				
STAATSEMISSIONEN				
Poland Government International Bond				
4,875 % fällig am 04.10.2033		1.500	1.475	0,08
RUMÄNIEN				
STAATSEMISSIONEN				
Romania Government International Bond				
1,375 % fällig am 02.12.2029	€	500	424	0,02
1,750 % fällig am 13.07.2030		2.500	2.086	0,12
2,625 % fällig am 02.12.2040		3.400	2.265	0,12
3,750 % fällig am 07.02.2034		900	796	0,04
4,625 % fällig am 03.04.2049		100	84	0,01
5,000 % fällig am 27.09.2026		400	438	0,02
Summe Rumänien			6.093	0,33
SERBIEN				
STAATSEMISSIONEN				
Serbia Government International Bond				
1,000 % fällig am 23.09.2028		1.500	1.270	0,07
1,650 % fällig am 03.03.2033		400	291	0,02
Summe Serbien			1.561	0,09

BESCHREIBUNG		PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
SINGAPUR				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Clean Renewable Power Mauritius Pte. Ltd.				
4,250 % fällig am 25.03.2027	$	1.209	$ 1.062	0,06
Pfizer Investment Enterprises Pte. Ltd.				
5,340 % fällig am 19.05.2063		1.250	1.266	0,07
SingTel Group Treasury Pte. Ltd.				
3,875 % fällig am 28.08.2028		900	863	0,05
United Overseas Bank Ltd.				
3,863 % fällig am 07.10.2032 (g)		4.000	3.750	0,20
Summe Singapur			6.941	0,38
SÜDKOREA				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Hana Bank				
3,750 % fällig am 04.05.2026	€	7.500	8.103	0,45
KB Kookmin Card Co. Ltd.				
1,500 % fällig am 13.05.2026	$	2.600	2.303	0,13
Kodit Global Co. Ltd.				
4,954 % fällig am 25.05.2026		3.700	3.643	0,20
Kookmin Bank				
2,500 % fällig am 04.11.2030 (g)		900	731	0,04
Shinhan Bank Co. Ltd.				
1,183 % fällig am 29.09.2025	AUD	1.100	666	0,04
4,000 % fällig am 23.04.2029 (g)	$	1.100	1.003	0,05
4,375 % fällig am 13.04.2032 (g)		2.200	2.006	0,11
5,862 % fällig am 16.11.2025	AUD	1.500	1.018	0,06
Shinhan Financial Group Co. Ltd.				
1,350 % fällig am 10.01.2026	$	300	270	0,01
SK Broadband Co. Ltd.				
3,875 % fällig am 13.08.2023		500	499	0,03
SK Hynix, Inc.				
1,000 % fällig am 19.01.2024		600	583	0,03
2,375 % fällig am 19.01.2031		1.000	772	0,04
6,375 % fällig am 17.01.2028		4.400	4.420	0,24
			26.017	1,43
STAATSEMISSIONEN				
Export-Import Bank of Korea				
2,125 % fällig am 18.01.2032		2.000	1.639	0,09
5,125 % fällig am 11.01.2033		3.600	3.693	0,20
Korea Expressway Corp.				
1,125 % fällig am 17.05.2026		1.000	886	0,05
Korea Housing Finance Corp.				
0,010 % fällig am 05.02.2025	€	400	408	0,02
4,625 % fällig am 24.02.2028	$	2.200	2.169	0,12
Korea Water Resources Corp.				
3,500 % fällig am 27.04.2025		3.500	3.375	0,19
			12.170	0,67
Summe Südkorea			38.187	2,10
SPANIEN				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A.				
5,862 % fällig am 14.09.2026		1.200	1.184	0,07
6,138 % fällig am 14.09.2028		1.000	1.003	0,06
Banco de Sabadell S.A.				
5,125 % fällig am 10.11.2028	€	1.500	1.651	0,09
Banco Santander S.A.				
0,625 % fällig am 24.06.2029		800	725	0,04
2,750 % fällig am 12.09.2023	£	400	505	0,03
3,490 % fällig am 28.05.2030	$	400	349	0,02
3,625 % fällig am 21.03.2029 (f)(g)	€	600	432	0,02
4,125 % fällig am 12.11.2027 (f)(g)		1.000	820	0,05
4,175 % fällig am 24.03.2028	$	2.000	1.874	0,10
4,375 % fällig am 14.01.2026 (f)(g)	€	400	367	0,02
Bankinter S.A.				
0,625 % fällig am 06.10.2027		1.000	932	0,05
CaixaBank S.A.				
0,625 % fällig am 21.01.2028		3.000	2.884	0,16
0,750 % fällig am 10.07.2026		600	609	0,03
1,500 % fällig am 03.12.2026	£	700	769	0,04
4,625 % fällig am 16.05.2027	€	1.000	1.081	0,06
5,375 % fällig am 14.11.2030		100	112	0,01
5,875 % fällig am 09.10.2027 (f)(g)		800	783	0,04

BESCHREIBUNG		PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
Caja Rural de Navarra SCC				
3,000 % fällig am 26.04.2027	€	1.700	$ 1.806	0,10
Cellnex Finance Co. S.A.				
3,875 % fällig am 07.07.2041	$	1.000	734	0,04
Werfen S.A.				
4,625 % fällig am 06.06.2028	€	2.200	2.370	0,13
			20.990	1,16
STAATSEMISSIONEN				
Autonomous Community of Andalusia				
3,950 % fällig am 30.04.2033		2.500	2.787	0,15
Junta de Castilla y Leon				
3,500 % fällig am 30.04.2033 (b)		1.400	1.503	0,08
Spain Government International Bond				
1,000 % fällig am 30.07.2042		3.170	2.181	0,12
Xunta de Galicia				
0,084 % fällig am 30.07.2027		150	143	0,01
			6.614	0,36
Summe Spanien			27.604	1,52
SUPRANATIONAL				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Asian Development Bank				
1,500 % fällig am 04.05.2028	CAD	2.000	1.347	0,07
6,550 % fällig am 26.01.2025	ZAR	64.000	3.246	0,18
Banque Ouest Africaine de Developpement				
2,750 % fällig am 22.01.2033	€	800	637	0,03
Eurofima Europäische Gesellschaft für die Finanzierung von Eisenbahnmaterial				
0,000 % fällig am 28.07.2026 (d)		1.000	978	0,05
3,125 % fällig am 09.11.2031		3.200	3.473	0,19
Europäische Bank für Wiederaufbau und Entwicklung				
1,500 % fällig am 13.02.2025	$	880	831	0,05
1,625 % fällig am 27.09.2024		500	477	0,03
Europäische Investitionsbank				
0,750 % fällig am 15.07.2027	AUD	2.100	1.205	0,07
1,500 % fällig am 15.06.2032	€	3.000	2.887	0,16
Europäische Union				
0,000 % fällig am 04.11.2025 (d)		1.400	1.414	0,08
0,000 % fällig am 04.10.2030 (d)		3.700	3.258	0,18
0,000 % fällig am 04.07.2035 (d)		1.700	1.281	0,07
0,300 % fällig am 04.11.2050		1.900	1.017	0,06
0,400 % fällig am 04.02.2037		2.150	1.643	0,09
1,250 % fällig am 04.02.2043		8.000	6.287	0,34
2,625 % fällig am 04.02.2048		2.880	2.840	0,16
2,750 % fällig am 04.02.2033		2.370	2.529	0,14
2,750 % fällig am 04.12.2037		10.000	10.391	0,57
Internationale Bank für Wiederaufbau und Entwicklung				
0,125 % fällig am 03.01.2051		1.600	780	0,04
2,900 % fällig am 19.01.2033		2.400	2.575	0,14
3,100 % fällig am 14.04.2038		2.900	3.130	0,17
Summe Supranational			52.226	2,87
SCHWEDEN				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
EQT AB				
0,875 % fällig am 14.05.2031		3.200	2.490	0,14
2,375 % fällig am 06.04.2028		1.000	962	0,05
2,875 % fällig am 06.04.2032		3.000	2.613	0,14
Sagax AB				
1,125 % fällig am 30.01.2027		800	737	0,04
Skandinaviska Enskilda Banken AB				
4,000 % fällig am 09.11.2026		1.500	1.618	0,09
Svenska Handelsbanken AB				
0,125 % fällig am 03.11.2026		300	289	0,02
Volvo Car AB				
2,500 % fällig am 07.10.2027		1.400	1.386	0,08
			10.095	0,56
STAATSEMISSIONEN				
Kommuninvest Sverige AB				
3,375 % fällig am 15.03.2027		700	765	0,04
Sweden Government International Bond				
0,125 % fällig am 09.09.2030	SEK	9.000	704	0,04
			1.469	0,08
Summe Schweden			11.564	0,64

BESCHREIBUNG		PAR (000S)		MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERM-ÖGENS
SCHWEIZ					
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL					
UBS AG					
1,375 % fällig am 13.01.2025	$	200	$	186	0,01
UBS Group AG					
1,008 % fällig am 30.07.2024		1.900		1.892	0,11
4,125 % fällig am 24.09.2025		4.300		4.111	0,23
4,125 % fällig am 15.04.2026		3.602		3.437	0,19
4,375 % fällig am 10.02.2031 (f)(g)		1.600		1.132	0,06
5,959 % fällig am 12.01.2034		800		796	0,04
Summe Schweiz				11.554	0,64
THAILAND					
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL					
Bangkok Bank PCL					
3,733 % fällig am 25.09.2034 (g)		250		212	0,01
GROSSBRITANNIEN					
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL					
Anglian Water Services Financing PLC					
2,750 % fällig am 26.10.2029	£	100		106	0,01
Assura Financing PLC					
1,625 % fällig am 30.06.2033		1.200		1.002	0,06
Barclays PLC					
2,667 % fällig am 10.03.2032	$	1.000		787	0,04
2,894 % fällig am 24.11.2032		300		236	0,01
5,501 % fällig am 09.08.2028		300		293	0,02
5,746 % fällig am 09.08.2033		3.350		3.241	0,18
6,224 % fällig am 09.05.2034		4.400		4.385	0,24
7,325 % fällig am 02.11.2026		800		818	0,05
7,437 % fällig am 02.11.2033		2.300		2.490	0,14
7,750 % fällig am 15.09.2023 (f)(g)		2.100		2.063	0,11
Berkeley Group PLC					
2,500 % fällig am 11.08.2031	£	3.550		2.951	0,16
British Telecommunications PLC					
3,250 % fällig am 08.11.2029	$	700		614	0,03
Brookfield Finance UK PLC					
2,340 % fällig am 30.01.2032		3.000		2.339	0,13
Burberry Group PLC					
1,125 % fällig am 21.09.2025	£	500		564	0,03
Cadent Finance PLC					
4,250 % fällig am 05.07.2029 (b)	€	800		869	0,05
5,750 % fällig am 14.03.2034	£	1.500		1.834	0,10
Chanel Ceres PLC					
0,500 % fällig am 31.07.2026	€	800		778	0,04
1,000 % fällig am 31.07.2031		2.600		2.266	0,12
Clarion Funding PLC					
1,250 % fällig am 13.11.2032	£	700		604	0,03
1,875 % fällig am 22.01.2035		200		171	0,01
CSL Finance PLC					
4,250 % fällig am 27.04.2032	$	1.100		1.042	0,06
Derwent London PLC					
1,875 % fällig am 17.11.2031	£	2.700		2.380	0,13
Direct Line Insurance Group PLC					
4,000 % fällig am 05.06.2032		300		276	0,02
ENW Finance PLC					
4,893 % fällig am 24.11.2032		1.700		1.992	0,11
Ferguson Finance PLC					
3,250 % fällig am 02.06.2030	$	900		782	0,04
Grainger PLC					
3,000 % fällig am 03.07.2030	£	1.260		1.214	0,07
HSBC Holdings PLC					
1,750 % fällig am 24.07.2027		3.100		3.361	0,18
2,013 % fällig am 22.09.2028	$	1.500		1.287	0,07
2,804 % fällig am 24.05.2032		1.200		971	0,05
2,848 % fällig am 04.06.2031		1.600		1.329	0,07
2,871 % fällig am 22.11.2032		1.300		1.049	0,06
2,999 % fällig am 10.03.2026		2.900		2.751	0,15
3,000 % fällig am 22.07.2028	£	100		109	0,01
3,973 % fällig am 22.05.2030	$	4.300		3.865	0,21
4,041 % fällig am 13.03.2028		1.800		1.687	0,09
5,402 % fällig am 11.08.2033		1.200		1.174	0,06
6,332 % fällig am 09.03.2044		500		519	0,03
7,336 % fällig am 03.11.2026		1.200		1.236	0,07
Informa PLC					
1,500 % fällig am 05.07.2023	€	237		259	0,01
2,125 % fällig am 06.10.2025		3.000		3.123	0,17
InterContinental Hotels Group PLC					
3,375 % fällig am 08.10.2028	£	4.400	$	4.751	0,26
John Lewis PLC					
4,250 % fällig am 18.12.2034		300		238	0,01
6,125 % fällig am 21.01.2025		100		122	0,01
Land Securities Capital Markets PLC					
4,875 % fällig am 15.09.2034		5.000		6.032	0,33
Legal & General Group PLC					
5,625 % fällig am 24.03.2031 (f)(g)		500		492	0,03
Lendlease Europe Finance PLC					
3,500 % fällig am 02.12.2033		1.349		1.123	0,06
Lloyds Banking Group PLC					
3,750 % fällig am 18.03.2028	$	1.600		1.479	0,08
4,582 % fällig am 10.12.2025		2.000		1.917	0,11
London & Quadrant Housing Trust					
2,000 % fällig am 31.03.2032	£	1.400		1.320	0,07
LSEGA Financing PLC					
3,200 % fällig am 06.04.2041	$	1.000		747	0,04
Marks & Spencer PLC					
4,500 % fällig am 10.07.2027	£	300		338	0,02
Motability Operations Group PLC					
1,500 % fällig am 20.01.2041		400		289	0,02
3,500 % fällig am 17.07.2031	€	2.300		2.459	0,14
National Grid Electricity Transmission PLC					
0,190 % fällig am 20.01.2025		500		513	0,03
National Grid PLC					
3,875 % fällig am 16.01.2029		1.600		1.732	0,10
Nationwide Building Society					
4,302 % fällig am 08.03.2029	$	900		835	0,05
4,363 % fällig am 01.08.2024		1.100		1.098	0,06
NatWest Group PLC					
0,780 % fällig am 26.02.2030	€	1.200		1.045	0,06
2,000 % fällig am 04.03.2025		300		321	0,02
2,057 % fällig am 09.11.2028	£	1.900		1.969	0,11
4,269 % fällig am 22.03.2025	$	2.500		2.456	0,14
4,699 % fällig am 14.03.2028	€	3.000		3.257	0,18
4,771 % fällig am 16.02.2029		900		968	0,05
4,892 % fällig am 18.05.2029	$	1.200		1.143	0,06
5,125 % fällig am 12.05.2027 (f)(g)	£	400		420	0,02
7,472 % fällig am 10.11.2026	$	3.800		3.889	0,21
Peabody Capital PLC					
2,750 % fällig am 02.03.2034	£	500		486	0,03
Pearson Funding PLC					
3,750 % fällig am 04.06.2030		500		540	0,03
Places for People Treasury PLC					
2,500 % fällig am 26.01.2036		2.200		1.915	0,11
Prudential Funding Asia PLC					
2,950 % fällig am 03.11.2033	$	600		507	0,03
Reckitt Benckiser Treasury Services PLC					
1,750 % fällig am 19.05.2032	£	100		95	0,01
Santander UK Group Holdings PLC					
1,673 % fällig am 14.06.2027	$	800		690	0,04
3,823 % fällig am 03.11.2028		2.300		2.072	0,11
6,833 % fällig am 21.11.2026		1.500		1.504	0,08
Severn Trent Utilities Finance PLC					
2,000 % fällig am 02.06.2040	£	300		222	0,01
2,625 % fällig am 22.02.2033		1.900		1.827	0,10
5,250 % fällig am 04.04.2036		1.900		2.253	0,12
SSE PLC					
1,750 % fällig am 16.04.2030	€	100		96	0,01
2,875 % fällig am 01.08.2029		300		311	0,02
Standard Chartered PLC					
0,800 % fällig am 17.11.2029		1.100		982	0,05
1,214 % fällig am 23.03.2025	$	800		769	0,04
1,456 % fällig am 14.01.2027		3.018		2.678	0,15
2,678 % fällig am 29.06.2032		500		392	0,02
4,874 % fällig am 10.05.2031	€	2.500		2.697	0,15
6,301 % fällig am 09.01.2029	$	500		503	0,03
7,767 % fällig am 16.11.2028		900		956	0,05
Tesco Corporate Treasury Services PLC					
1,875 % fällig am 02.11.2028	£	2.600		2.645	0,15
2,750 % fällig am 27.04.2030		500		513	0,03
Tesco Property Finance PLC					
5,744 % fällig am 13.04.2040		191		226	0,01
Thames Water Utilities Finance PLC					
0,875 % fällig am 31.01.2028	€	3.000		2.612	0,14
4,375 % fällig am 18.01.2031		2.000		1.947	0,11
TP ICAP Finance PLC					
2,625 % fällig am 18.11.2028	£	300	$	282	0,02
7,875 % fällig am 17.04.2030		1.200		1.447	0,08
Travis Perkins PLC					
3,750 % fällig am 17.02.2026		1.000		1.144	0,06
Virgin Money UK PLC					
4,000 % fällig am 25.09.2026		200		230	0,01
4,000 % fällig am 03.09.2027		3.000		3.339	0,18
Vmed O2 UK Financing PLC					
3,250 % fällig am 31.01.2031	€	700		629	0,03
4,500 % fällig am 15.07.2031	£	1.000		968	0,05
Vodafone Group PLC					
5,125 % fällig am 04.06.2081	$	2.659		1.933	0,11
Weir Group PLC					
2,200 % fällig am 13.05.2026		11.800		10.576	0,58
6,875 % fällig am 14.06.2028	£	200		251	0,01
Workspace Group PLC					
2,250 % fällig am 11.03.2028		1.600		1.491	0,08
Yorkshire Building Society					
3,511 % fällig am 11.10.2030		2.400		2.501	0,14
6,375 % fällig am 15.11.2028		2.000		2.421	0,13
Zenith Finco PLC					
6,500 % fällig am 30.06.2027		2.300		2.233	0,12
				158.653	8,72
NON-AGENCY-MBS					
Gemgarto PLC					
5,479 % fällig am 16.12.2067		381		483	0,03
STAATSEMISSIONEN					
United Kingdom Gilt					
0,875 % fällig am 31.07.2033		6.550		5.969	0,33
1,250 % fällig am 22.07.2027		4.800		5.299	0,29
3,750 % fällig am 22.10.2053		4.700		5.315	0,29
				16.583	0,91
Summe Großbritannien				175.719	9,66
USA					
FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE					
GoodLeap Sustainable Home Solutions Trust					
2,100 % fällig am 20.05.2048	$	2.772		2.133	0,12
4,000 % fällig am 20.04.2049		5.314		4.664	0,26
4,950 % fällig am 20.07.2049		6.320		5.815	0,32
5,520 % fällig am 22.02.2055		3.334		3.183	0,17
				15.795	0,87
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL					
AES Corp.					
1,375 % fällig am 15.01.2026		4.319		3.860	0,21
2,450 % fällig am 15.01.2031		5.600		4.530	0,25
5,450 % fällig am 01.06.2028		3.770		3.705	0,20
Alcon Finance Corp.					
3,000 % fällig am 23.09.2029		1.900		1.678	0,09
Alexandria Real Estate Equities, Inc.					
2,000 % fällig am 18.05.2032		3.350		2.534	0,14
4,750 % fällig am 15.04.2035		4.000		3.716	0,20
Ally Financial, Inc.					
2,200 % fällig am 02.11.2028		800		639	0,03
8,000 % fällig am 01.11.2031		300		312	0,02
American Assets Trust LP					
3,375 % fällig am 01.02.2031		400		313	0,02
American Express Co.					
4,050 % fällig am 03.05.2029		2.900		2.764	0,15
6,052 % fällig am 03.08.2023		2.062		2.062	0,11
American Tower Corp.					
0,875 % fällig am 21.05.2029	€	500		445	0,02
0,950 % fällig am 05.10.2030		650		557	0,03
1,000 % fällig am 15.01.2032		3.100		2.533	0,14
1,450 % fällig am 15.09.2026	$	400		352	0,02
1,875 % fällig am 15.10.2030		5.600		4.426	0,24
1,950 % fällig am 22.05.2026	€	200		203	0,01
2,100 % fällig am 15.06.2030	$	1.000		809	0,04
3,650 % fällig am 15.03.2027		1.000		937	0,05
3,950 % fällig am 15.03.2029		900		831	0,05
4,050 % fällig am 15.03.2032		400		365	0,02
Amgen, Inc.					
2,250 % fällig am 19.08.2023		1.300		1.295	0,07

BESCHREIBUNG		PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
5,150 % fällig am 02.03.2028	$	2.800	$ 2.799	0,15
5,250 % fällig am 02.03.2030		4.400	4.412	0,24
5,600 % fällig am 02.03.2043		1.600	1.606	0,09
5,650 % fällig am 02.03.2053		50	51	0,00
5,750 % fällig am 02.03.2063		100	102	0,01
Apple, Inc.				
2,200 % fällig am 11.09.2029		1.961	1.722	0,09
4,150 % fällig am 10.05.2030		1.050	1.034	0,06
4,300 % fällig am 10.05.2033		550	547	0,03
Assured Guaranty U.S. Holdings, Inc.				
3,600 % fällig am 15.09.2051		550	378	0,02
Astrazeneca Finance LLC				
1,750 % fällig am 28.05.2028		100	87	0,00
4,900 % fällig am 03.03.2030		1.300	1.303	0,07
AT&T, Inc.				
3,550 % fällig am 15.09.2055		246	172	0,01
4,300 % fällig am 15.02.2030		1.300	1.235	0,07
4,850 % fällig am 25.05.2047 (h)	CAD	1.500	1.015	0,06
Autodesk, Inc.				
2,400 % fällig am 15.12.2031	$	2.900	2.375	0,13
Bank of America Corp.				
0,583 % fällig am 24.08.2028	€	200	187	0,01
1,102 % fällig am 24.05.2032		300	258	0,01
1,734 % fällig am 22.07.2027	$	300	268	0,01
1,898 % fällig am 23.07.2031		2.700	2.151	0,12
2,087 % fällig am 14.06.2029		2.400	2.049	0,11
2,299 % fällig am 21.07.2032		600	480	0,03
2,456 % fällig am 22.10.2025		1.700	1.624	0,09
2,687 % fällig am 22.04.2032		6.600	5.472	0,30
2,824 % fällig am 27.04.2033	€	700	681	0,04
2,884 % fällig am 22.10.2030	$	1.100	948	0,05
2,972 % fällig am 04.02.2033		300	250	0,01
3,384 % fällig am 02.04.2026		7.800	7.481	0,42
3,458 % fällig am 15.03.2025		1.100	1.078	0,06
3,559 % fällig am 23.04.2027		2.600	2.466	0,14
4,412 % fällig am 24.08.2025	€	1.400	1.533	0,08
5,015 % fällig am 22.07.2033	$	4.900	4.796	0,26
6,204 % fällig am 10.11.2028		4.060	4.176	0,23
Bank of New York Mellon Corp.				
4,543 % fällig am 01.02.2029		4.300	4.189	0,23
4,706 % fällig am 01.02.2034		2.800	2.691	0,15
5,802 % fällig am 25.10.2028		3.500	3.570	0,20
Baxter International, Inc.				
5,351 % fällig am 01.12.2023		350	349	0,02
Blackstone Holdings Finance Co. LLC				
2,850 % fällig am 05.08.2051		600	345	0,02
6,200 % fällig am 22.04.2033		400	409	0,02
Blue Owl Finance LLC				
3,125 % fällig am 10.06.2031		200	152	0,01
BlueHub Loan Fund, Inc.				
3,099 % fällig am 01.01.2030		650	533	0,03
Booking Holdings, Inc.				
0,100 % fällig am 08.03.2025	€	500	511	0,03
4,125 % fällig am 12.05.2033		600	652	0,04
Boston Properties LP				
2,550 % fällig am 01.04.2032	$	930	702	0,04
6,500 % fällig am 15.01.2034		2.800	2.820	0,15
Brandywine Operating Partnership LP				
3,950 % fällig am 15.11.2027		500	397	0,02
Bush Foundation				
2,754 % fällig am 01.10.2050		375	252	0,01
Capital One Financial Corp.				
5,468 % fällig am 01.02.2029		100	96	0,01
6,377 % fällig am 08.06.2034		2.200	2.185	0,12
CBRE Services, Inc.				
2,500 % fällig am 01.04.2031		1.000	805	0,04
Centene Corp.				
2,625 % fällig am 01.08.2031		600	479	0,03
3,000 % fällig am 15.10.2030		8.700	7.258	0,40
CenterPoint Energy Houston Electric LLC				
5,300 % fällig am 01.04.2053		5.250	5.375	0,30
Charles Schwab Corp.				
2,000 % fällig am 20.03.2028		300	259	0,01
4,000 % fällig am 01.12.2030 (f)		1.400	1.028	0,06
5,643 % fällig am 19.05.2029		600	600	0,03
5,853 % fällig am 19.05.2034		600	609	0,03
Church & Dwight Co., Inc.				
5,600 % fällig am 15.11.2032		1.200	1.269	0,07
Cigna Group				
3,750 % fällig am 15.07.2023	$	163	$ 163	0,01
Citigroup, Inc.				
2,520 % fällig am 03.11.2032		1.400	1.129	0,06
2,572 % fällig am 03.06.2031 (h)		8.100	6.762	0,37
4,658 % fällig am 24.05.2028		0	0	0,00
5,746 % fällig am 25.01.2026 (h)		2.000	1.992	0,11
6,270 % fällig am 17.11.2033 (h)		0	0	0,00
6,462 % fällig am 24.05.2025		1.400	1.406	0,08
Citizens Bank N.A.				
5,284 % fällig am 26.01.2026		3.650	3.390	0,19
Clearway Energy Operating LLC				
3,750 % fällig am 15.01.2032		700	571	0,03
Comcast Corp.				
4,650 % fällig am 15.02.2033		3.810	3.784	0,21
5,500 % fällig am 15.05.2064		2.000	2.030	0,11
CommonSpirit Health				
2,782 % fällig am 01.10.2030		600	505	0,03
Commonwealth Edison Co.				
2,200 % fällig am 01.03.2030		1.000	846	0,05
Community Preservation Corp.				
2,867 % fällig am 01.02.2030		1.225	1.028	0,06
Continental Wind LLC				
6,000 % fällig am 28.02.2033		2.406	2.433	0,13
Corebridge Financial, Inc.				
3,900 % fällig am 05.04.2032		7.150	6.222	0,34
Corporate Office Properties LP				
2,000 % fällig am 15.01.2029		700	534	0,03
2,250 % fällig am 15.03.2026		500	443	0,02
2,750 % fällig am 15.04.2031		400	304	0,02
Crown Castle, Inc.				
2,500 % fällig am 15.07.2031		1.000	822	0,05
3,250 % fällig am 15.01.2051		600	410	0,02
5,000 % fällig am 11.01.2028		2.600	2.554	0,14
5,200 % fällig am 15.02.2049		100	93	0,01
CVS Health Corp.				
4,300 % fällig am 25.03.2028		192	185	0,01
5,125 % fällig am 21.02.2030		3.800	3.776	0,21
CVS Pass-Through Trust				
4,163 % fällig am 11.08.2036		113	97	0,01
Dell International LLC				
3,375 % fällig am 15.12.2041		1.470	1.038	0,06
6,020 % fällig am 15.06.2026		1.200	1.220	0,07
8,350 % fällig am 15.07.2046		25	31	0,00
Digital Euro Finco LLC				
2,500 % fällig am 16.01.2026	€	950	966	0,05
Digital Realty Trust LP				
3,600 % fällig am 01.07.2029	$	1.500	1.334	0,07
Digital Stout Holding LLC				
3,300 % fällig am 19.07.2029	£	100	103	0,01
3,750 % fällig am 17.10.2030		400	415	0,02
Discover Bank				
3,450 % fällig am 27.07.2026	$	3.860	3.555	0,20
4,200 % fällig am 08.08.2023		2.000	1.996	0,11
Discovery Communications LLC				
4,875 % fällig am 01.04.2043		1.900	1.548	0,08
Doris Duke Charitable Foundation				
2,345 % fällig am 01.07.2050		400	244	0,01
DTE Electric Co.				
1,900 % fällig am 01.04.2028		1.500	1.314	0,07
3,250 % fällig am 01.04.2051		1.100	797	0,04
3,950 % fällig am 01.03.2049		700	577	0,03
Duke Energy Florida LLC				
2,500 % fällig am 01.12.2029		300	259	0,01
Duke Energy Progress LLC				
3,450 % fällig am 15.03.2029		1.300	1.193	0,07
Elevance Health, Inc.				
2,875 % fällig am 15.09.2029		1.812	1.598	0,09
Eli Lilly & Co.				
1,375 % fällig am 14.09.2061	€	700	405	0,02
Empower Finance LP				
1,776 % fällig am 17.03.2031	$	0	0	0,00
Enel Finance America LLC				
7,100 % fällig am 14.10.2027		1.250	1.314	0,07
Entergy Louisiana LLC				
4,750 % fällig am 15.09.2052		1.700	1.563	0,09
Equifax, Inc.				
5,100 % fällig am 01.06.2028	$	1.200	$ 1.183	0,06
Equinix, Inc.				
2,500 % fällig am 15.05.2031		1.600	1.304	0,07
Equitable Financial Life Global Funding				
0,600 % fällig am 16.06.2028	€	1.300	1.194	0,07
1,300 % fällig am 12.07.2026	$	4.450	3.884	0,21
5,500 % fällig am 02.12.2025		1.600	1.580	0,09
ERAC USA Finance LLC				
3,800 % fällig am 01.11.2025		5.000	4.785	0,26
Essential Properties LP				
2,950 % fällig am 15.07.2031		200	150	0,01
Eversource Energy				
1,650 % fällig am 15.08.2030		800	635	0,03
F&G Global Funding				
2,300 % fällig am 11.04.2027		700	619	0,03
FactSet Research Systems, Inc.				
3,450 % fällig am 01.03.2032		4.100	3.492	0,19
Farmers Exchange Capital				
5,454 % fällig am 15.10.2054		400	352	0,02
Fifth Third Bancorp				
6,361 % fällig am 27.10.2028		2.200	2.192	0,12
First American Financial Corp.				
2,400 % fällig am 15.08.2031		3.600	2.741	0,15
4,000 % fällig am 15.05.2030		700	614	0,03
Fiserv, Inc.				
3,000 % fällig am 01.07.2031	£	100	102	0,01
Ford Motor Credit Co. LLC				
1,744 % fällig am 19.07.2024	€	900	951	0,05
3,021 % fällig am 06.03.2024		300	323	0,02
4,174 % fällig am 01.12.2024		200	216	0,01
4,535 % fällig am 06.03.2025	£	400	484	0,03
FS KKR Capital Corp.				
3,125 % fällig am 12.10.2028	$	1.300	1.060	0,06
Gap, Inc.				
3,625 % fällig am 01.10.2029		2.550	1.805	0,10
Gilead Sciences, Inc.				
2,500 % fällig am 01.09.2023		875	870	0,05
Goldman Sachs Group, Inc.				
1,000 % fällig am 16.12.2025	£	200	235	0,01
1,000 % fällig am 18.03.2033	€	600	488	0,03
1,500 % fällig am 07.12.2027	£	800	823	0,05
1,542 % fällig am 10.09.2027	$	400	352	0,02
1,875 % fällig am 16.12.2030	£	1.100	1.038	0,06
1,992 % fällig am 27.01.2032	$	1.000	788	0,04
2,383 % fällig am 21.07.2032		900	721	0,04
2,615 % fällig am 22.04.2032		7.400	6.071	0,33
2,640 % fällig am 24.02.2028		3.300	2.997	0,16
2,650 % fällig am 21.10.2032		900	734	0,04
3,102 % fällig am 24.02.2033		1.100	930	0,05
3,125 % fällig am 25.07.2029	£	400	425	0,02
3,691 % fällig am 05.06.2028	$	500	470	0,03
3,750 % fällig am 30.04.2024	€	300	327	0,02
5,236 % fällig am 02.05.2024	AUD	2.000	1.334	0,07
Goodman U.S. Finance Five LLC				
4,625 % fällig am 04.05.2032	$	4.100	3.773	0,21
Great-West Lifeco Finance LP				
4,047 % fällig am 17.05.2028		500	468	0,03
Haleon U.S. Capital LLC				
3,375 % fällig am 24.03.2029		2.550	2.319	0,13
Hanover Insurance Group, Inc.				
2,500 % fällig am 01.09.2030		300	237	0,01
HAT Holdings LLC				
3,375 % fällig am 15.06.2026		255	229	0,01
3,750 % fällig am 15.09.2030		3.200	2.514	0,14
HCA, Inc.				
4,125 % fällig am 15.06.2029		4.700	4.352	0,24
4,500 % fällig am 15.02.2027		1.700	1.641	0,09
5,000 % fällig am 15.03.2024		2.000	1.988	0,11
Healthpeak OP LLC				
2,125 % fällig am 01.12.2028		1.750	1.477	0,08
Host Hotels & Resorts LP				
2,900 % fällig am 15.12.2031		2.200	1.733	0,10
3,375 % fällig am 15.12.2029		5.800	4.962	0,27
3,875 % fällig am 01.04.2024		100	98	0,01
4,000 % fällig am 15.06.2025		500	481	0,03
4,500 % fällig am 01.02.2026		100	97	0,01

BESCHREIBUNG		PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
Hudson Pacific Properties LP				
5,950 % fällig am 15.02.2028	$	3.600	$ 2.865	0,16
Humana, Inc.				
1,350 % fällig am 03.02.2027		1.250	1.088	0,06
3,700 % fällig am 23.03.2029		3.200	2.933	0,16
3,950 % fällig am 15.03.2027		95	91	0,01
5,875 % fällig am 01.03.2033		3.000	3.119	0,17
International Flavors & Fragrances, Inc.				
1,832 % fällig am 15.10.2027		1.600	1.351	0,07
Interstate Power & Light Co.				
3,600 % fällig am 01.04.2029		1.200	1.097	0,06
IQVIA, Inc.				
5,700 % fällig am 15.05.2028		3.000	2.974	0,16
John Deere Capital Corp.				
3,350 % fällig am 18.04.2029		1.900	1.769	0,10
JPMorgan Chase & Co.				
1,045 % fällig am 19.11.2026		1.500	1.344	0,07
2,545 % fällig am 08.11.2032		8.750	7.173	0,39
2,580 % fällig am 22.04.2032		7.400	6.149	0,34
2,739 % fällig am 15.10.2030		1.800	1.552	0,09
4,203 % fällig am 23.07.2029		1.500	1.427	0,08
4,323 % fällig am 26.04.2028		4.500	4.346	0,24
4,565 % fällig am 14.06.2030		300	289	0,02
4,912 % fällig am 25.07.2033		5.600	5.474	0,30
6,163 % fällig am 23.07.2024		1.100	1.101	0,06
Kaiser Foundation Hospitals				
2,810 % fällig am 01.06.2041		2.850	2.096	0,12
Kellogg Co.				
2,650 % fällig am 01.12.2023		734	727	0,04
Kilroy Realty LP				
2,650 % fällig am 15.11.2033		6.400	4.344	0,24
3,050 % fällig am 15.02.2030		400	313	0,02
Lazard Group LLC				
4,375 % fällig am 11.03.2029		200	186	0,01
Lennox International, Inc.				
3,000 % fällig am 15.11.2023		1.480	1.463	0,08
Liberty Mutual Group, Inc.				
3,625 % fällig am 23.05.2059	€	200	208	0,01
Liberty Utilities Finance GP				
2,050 % fällig am 15.09.2030	$	1.800	1.400	0,08
Low Income Investment Fund				
3,711 % fällig am 01.07.2029		300	269	0,01
Marriott International, Inc.				
4,900 % fällig am 15.04.2029		1.300	1.265	0,07
McLaren Health Care Corp.				
4,386 % fällig am 15.05.2048		200	177	0,01
Mercedes-Benz Finance North America LLC				
4,950 % fällig am 30.03.2025		2.500	2.482	0,14
Merck & Co., Inc.				
1,900 % fällig am 10.12.2028		2.000	1.748	0,10
4,900 % fällig am 17.05.2044		1.950	1.956	0,11
Metropolitan Life Global Funding				
0,375 % fällig am 09.04.2024	€	300	319	0,02
Micron Technology, Inc.				
2,703 % fällig am 15.04.2032	$	1.800	1.421	0,08
MidAmerican Energy Co.				
2,700 % fällig am 01.08.2052		1.250	792	0,04
3,150 % fällig am 15.04.2050		1.150	807	0,04
3,650 % fällig am 01.08.2048		4.629	3.571	0,20
3,950 % fällig am 01.08.2047		1.060	865	0,05
Moody's Corp.				
2,000 % fällig am 19.08.2031		700	565	0,03
2,550 % fällig am 18.08.2060		500	277	0,02
3,100 % fällig am 29.11.2061		400	264	0,01
3,250 % fällig am 15.01.2028		300	280	0,02
Morgan Stanley				
1,102 % fällig am 29.04.2033	€	600	497	0,03
1,375 % fällig am 27.10.2026		1.350	1.349	0,07
1,928 % fällig am 28.04.2032	$	8.900	6.952	0,38
5,050 % fällig am 28.01.2027		1.000	992	0,05
5,123 % fällig am 01.02.2029		8.100	7.993	0,44
6,342 % fällig am 18.10.2033		6.000	6.386	0,35
Morgan Stanley Domestic Holdings, Inc.				
4,500 % fällig am 20.06.2028		1.500	1.446	0,08
MPT Operating Partnership LP				
2,550 % fällig am 05.12.2023	£	200	246	0,01
MSCI, Inc.				
3,250 % fällig am 15.08.2033	$	800	$ 645	0,04
4,000 % fällig am 15.11.2029		100	91	0,01
National Rural Utilities Cooperative Finance Corp.				
4,150 % fällig am 15.12.2032		2.550	2.367	0,13
Netflix, Inc.				
3,625 % fällig am 15.06.2030	€	1.500	1.560	0,09
3,875 % fällig am 15.11.2029		3.400	3.622	0,20
Neuberger Berman Group LLC				
4,875 % fällig am 15.04.2045	$	200	164	0,01
New York State Electric & Gas Corp.				
2,150 % fällig am 01.10.2031		400	313	0,02
Niagara Mohawk Power Corp.				
1,960 % fällig am 27.06.2030		3.000	2.402	0,13
5,783 % fällig am 16.09.2052		2.690	2.701	0,15
Northern States Power Co.				
2,600 % fällig am 01.06.2051		1.300	835	0,05
2,900 % fällig am 01.03.2050		1.700	1.173	0,06
NSTAR Electric Co.				
4,950 % fällig am 15.09.2052		1.300	1.264	0,07
Nuveen LLC				
4,000 % fällig am 01.11.2028		300	283	0,02
NVR, Inc.				
3,000 % fällig am 15.05.2030		2.000	1.734	0,10
Oracle Corp.				
3,950 % fällig am 25.03.2051 (h)		300	227	0,01
Pacific Gas & Electric Co.				
6,700 % fällig am 01.04.2053		3.200	3.145	0,17
Pacific Life Global Funding				
1,375 % fällig am 14.04.2026		605	541	0,03
1,600 % fällig am 21.09.2028		1.000	818	0,04
2,450 % fällig am 11.01.2032		2.000	1.607	0,09
5,890 % fällig am 06.12.2024		2.000	1.992	0,11
Pacific LifeCorp.				
3,350 % fällig am 15.09.2050		200	139	0,01
PacifiCorp				
5,350 % fällig am 01.12.2053		1.200	1.098	0,06
5,500 % fällig am 15.05.2054		4.700	4.416	0,24
Penn Mutual Life Insurance Co.				
3,800 % fällig am 29.04.2061		1.800	1.221	0,07
Physicians Realty LP				
3,950 % fällig am 15.01.2028		800	731	0,04
PNC Bank N.A.				
2,700 % fällig am 22.10.2029		600	502	0,03
PNC Financial Services Group, Inc.				
4,758 % fällig am 26.01.2027		5.880	5.750	0,32
Principal Life Global Funding				
1,250 % fällig am 16.08.2026		2.750	2.400	0,13
1,375 % fällig am 10.01.2025		2.000	1.866	0,10
Prologis Euro Finance LLC				
1,500 % fällig am 08.02.2034	€	3.250	2.645	0,15
Prologis LP				
2,250 % fällig am 15.01.2032	$	600	485	0,03
Protective Life Global Funding				
1,618 % fällig am 15.04.2026		800	717	0,04
1,737 % fällig am 21.09.2030		800	628	0,03
1,900 % fällig am 06.07.2028		300	256	0,01
6,140 % fällig am 11.12.2024		5.000	5.015	0,28
Providence St. Joseph Health Obligated Group				
5,403 % fällig am 01.10.2033		2.900	2.864	0,16
Public Service Co. of Colorado				
2,700 % fällig am 15.01.2051		625	396	0,02
3,200 % fällig am 01.03.2050		2.827	2.000	0,11
3,700 % fällig am 15.06.2028		2.100	1.995	0,11
Public Service Co. of Oklahoma				
3,150 % fällig am 15.08.2051		2.600	1.728	0,09
Public Service Electric & Gas Co.				
3,100 % fällig am 15.03.2032		2.950	2.581	0,14
4,650 % fällig am 15.03.2033		4.700	4.616	0,25
Puget Sound Energy, Inc.				
5,448 % fällig am 01.06.2053		4.050	4.083	0,22
Qorvo, Inc.				
1,750 % fällig am 15.12.2024		4.900	4.561	0,25
Quanta Services, Inc.				
2,900 % fällig am 01.10.2030		5.500	4.677	0,26
Rayonier LP				
2,750 % fällig am 17.05.2031	$	1.500	$ 1.208	0,07
Realty Income Corp.				
1,750 % fällig am 13.07.2033	£	2.000	1.701	0,09
4,700 % fällig am 15.12.2028	$	1.000	970	0,05
Regency Centers LP				
2,950 % fällig am 15.09.2029		1.100	945	0,05
Reinsurance Group of America, Inc.				
6,000 % fällig am 15.09.2033		1.500	1.511	0,08
Reliance Steel & Aluminum Co.				
2,150 % fällig am 15.08.2030		1.000	816	0,04
RELX Capital, Inc.				
4,000 % fällig am 18.03.2029		700	668	0,04
RGA Global Funding				
2,700 % fällig am 18.01.2029		1.000	863	0,05
S&P Global, Inc.				
2,700 % fällig am 01.03.2029		5.500	4.954	0,27
Salesforce, Inc.				
1,500 % fällig am 15.07.2028		1.750	1.509	0,08
San Diego Gas & Electric Co.				
2,950 % fällig am 15.08.2051		1.750	1.187	0,07
Santander Holdings USA, Inc.				
2,490 % fällig am 06.01.2028		1.400	1.210	0,07
SBA Tower Trust				
1,631 % fällig am 15.05.2051		1.000	864	0,05
SCE Recovery Funding LLC				
4,697 % fällig am 15.06.2042		2.000	1.950	0,11
ServiceNow, Inc.				
1,400 % fällig am 01.09.2030		3.200	2.536	0,14
SLM Corp.				
3,125 % fällig am 02.11.2026		1.400	1.212	0,07
Solar Star Funding LLC				
5,375 % fällig am 30.06.2035		1.866	1.840	0,10
Southern California Edison Co.				
2,500 % fällig am 01.06.2031		200	166	0,01
3,600 % fällig am 01.02.2045		1.600	1.179	0,06
3,650 % fällig am 01.06.2051		2.500	1.859	0,10
3,900 % fällig am 01.12.2041		100	78	0,00
4,500 % fällig am 01.09.2040		190	166	0,01
4,875 % fällig am 01.03.2049		200	180	0,01
5,950 % fällig am 01.11.2032		3.750	3.928	0,22
Southwestern Public Service Co.				
5,150 % fällig am 01.06.2052		2.000	1.862	0,10
Spirit Realty LP				
4,450 % fällig am 15.09.2026		100	94	0,01
Sprint LLC				
7,875 % fällig am 15.09.2023		100	100	0,01
Standard Industries, Inc.				
2,250 % fällig am 21.11.2026	€	1.600	1.555	0,09
State Street Corp.				
3,700 % fällig am 20.11.2023	$	2.000	1.982	0,11
5,751 % fällig am 04.11.2026		2.600	2.615	0,14
Synchrony Financial				
2,875 % fällig am 28.10.2031		500	364	0,02
4,375 % fällig am 19.03.2024		650	637	0,03
7,250 % fällig am 02.02.2033		700	631	0,03
T-Mobile USA, Inc.				
2,400 % fällig am 15.03.2029		450	387	0,02
2,550 % fällig am 15.02.2031		2.000	1.663	0,09
2,625 % fällig am 15.02.2029		1.000	869	0,05
3,300 % fällig am 15.02.2051		900	632	0,03
3,600 % fällig am 15.11.2060		300	211	0,01
3,875 % fällig am 15.04.2030		700	645	0,04
Teachers Insurance & Annuity Association of America				
4,270 % fällig am 15.05.2047		400	331	0,02
Topaz Solar Farms LLC				
5,750 % fällig am 30.09.2039		1.324	1.300	0,07
Toyota Motor Credit Corp.				
3,050 % fällig am 22.03.2027		1.300	1.218	0,07
5,810 % fällig am 11.12.2023		3.900	3.905	0,21
Travel + Leisure Co.				
5,650 % fällig am 01.04.2024		300	297	0,02
Truist Financial Corp.				
1,267 % fällig am 02.03.2027		1.900	1.677	0,09
4,873 % fällig am 26.01.2029		5.250	5.050	0,28
5,122 % fällig am 26.01.2034		2.750	2.607	0,14

BESCHREIBUNG		PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERM-ÖGENS
U.S. Bancorp				
5,727 % fällig am 21.10.2026	$	1.800	$ 1.800	0,10
5,836 % fällig am 12.06.2034		600	605	0,03
UDR, Inc.				
3,100 % fällig am 01.11.2034		1.800	1.435	0,08
UnitedHealth Group, Inc.				
5,350 % fällig am 15.02.2033		1.400	1.456	0,08
5,875 % fällig am 15.02.2053		600	667	0,04
USAA Capital Corp.				
2,125 % fällig am 01.05.2030		1.000	833	0,05
3,375 % fällig am 01.05.2025		1.300	1.249	0,07
VeriSign, Inc.				
2,700 % fällig am 15.06.2031		1.100	916	0,05
Verizon Communications, Inc.				
0,375 % fällig am 22.03.2029	€	800	717	0,04
1,500 % fällig am 18.09.2030	$	5.560	4.397	0,24
2,100 % fällig am 22.03.2028		700	615	0,03
2,355 % fällig am 15.03.2032		600	483	0,03
2,850 % fällig am 03.09.2041		1.550	1.104	0,06
3,400 % fällig am 22.03.2041		500	386	0,02
3,700 % fällig am 22.03.2061		261	190	0,01
3,875 % fällig am 08.02.2029		2.400	2.252	0,12
4,329 % fällig am 21.09.2028		600	579	0,03
5,050 % fällig am 09.05.2033		2.000	1.979	0,11
VF Corp.				
2,950 % fällig am 23.04.2030		3.500	2.878	0,16
VMware, Inc.				
2,200 % fällig am 15.08.2031		0	0	0,00
4,700 % fällig am 15.05.2030		3.000	2.865	0,16
Warnermedia Holdings, Inc.				
4,279 % fällig am 15.03.2032		4.100	3.638	0,20
5,391 % fällig am 15.03.2062		500	408	0,02
Wells Fargo & Co.				
4,540 % fällig am 15.08.2026		3.100	3.030	0,17
Weyerhaeuser Co.				
4,000 % fällig am 15.11.2029		3.000	2.769	0,15
6,875 % fällig am 15.12.2033		70	76	0,00
Wisconsin Electric Power Co.				
4,750 % fällig am 30.09.2032		1.850	1.813	0,10
Wisconsin Power & Light Co.				
4,950 % fällig am 01.04.2033		6.760	6.692	0,37
Wisconsin Public Service Corp.				
2,850 % fällig am 01.12.2051		2.250	1.487	0,08
WP Carey, Inc.				
2,450 % fällig am 01.02.2032		1.200	941	0,05
Xylem, Inc.				
2,250 % fällig am 30.01.2031	$	1.080	$ 897	0,05
Zoetis, Inc.				
2,000 % fällig am 15.05.2030		0	0	0,00
			566.665	31,16
KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG				
Hilton Domestic Operating Co., Inc.				
6,939 % fällig am 22.06.2026		1.200	1.201	0,07
IQVIA, Inc.				
5,598 % fällig am 07.03.2024	€	1.000	1.091	0,06
			2.292	0,13
KOMMUNALANLEIHEN UND WECHSEL				
California Health Facilities Financing Authority Revenue Bonds, Series 2022				
4,190 % fällig am 01.06.2037	$	2.100	1.965	0,11
University of Michigan Revenue Bonds, Series 2022				
3,504 % fällig am 01.04.2052		1.300	1.051	0,05
University of Pittsburgh of the Commonwealth System of Higher Education, Pennsylvania Revenue Bonds, Series 2017				
3,646 % fällig am 15.09.2036		2.000	1.819	0,10
			4.835	0,26
US-REGIERUNGSBEHÖRDEN				
Freddie Mac				
0,375 % fällig am 23.09.2025		1.700	1.543	0,08
1,147 % fällig am 25.08.2029 (a)		2.322	109	0,01
Uniform Mortgage-Backed Security				
3,000 % fällig am 01.07.2052		6.588	5.809	0,32
3,500 % fällig am 01.12.2052		99	90	0,01
4,000 % fällig am 01.12.2052 - 01.06.2053		14.160	13.298	0,73
4,500 % fällig am 01.07.2052 - 01.06.2053		26.506	25.500	1,40
Uniform Mortgage-Backed Security, TBA				
4,000 % fällig am 01.08.2053		48.670	45.717	2,51
5,000 % fällig am 01.08.2053		19.900	19.504	1,07
6,000 % fällig am 01.07.2053		111.500	112.493	6,18
			224.063	12,31
US-SCHATZOBLIGATIONEN				
U.S. Treasury Bonds				
1,625 % fällig am 15.11.2050		4.770	2.965	0,16
1,875 % fällig am 15.02.2041	$	18.150	$ 13.195	0,73
2,000 % fällig am 15.11.2041 (i)		39.500	28.941	1,59
2,250 % fällig am 15.05.2041 (i)		28.900	22.281	1,23
2,375 % fällig am 15.02.2042 (i)		58.900	45.885	2,52
2,875 % fällig am 15.05.2052		2.620	2.172	0,12
3,000 % fällig am 15.02.2048		462	390	0,02
3,125 % fällig am 15.08.2044		432	374	0,02
3,125 % fällig am 15.05.2048		42	36	0,00
3,250 % fällig am 15.05.2042 (i)		38.800	34.643	1,90
3,375 % fällig am 15.08.2042		13.000	11.806	0,65
3,875 % fällig am 15.05.2043 (j)		7.100	6.929	0,38
4,000 % fällig am 15.11.2042 (i)		27.600	27.436	1,51
U.S. Treasury Inflation Protected Securities (e)				
0,625 % fällig am 15.07.2032 (i)		31.422	28.898	1,59
U.S. Treasury Notes				
0,500 % fällig am 30.11.2023 (i)		22.700	22.254	1,22
0,750 % fällig am 30.04.2026		7.400	6.665	0,37
3,125 % fällig am 31.08.2027		3.250	3.109	0,17
4,250 % fällig am 31.05.2025 (i)(j)		30.800	30.414	1,67
4,250 % fällig am 15.10.2025		13.700	13.549	0,74
4,625 % fällig am 15.03.2026		310	310	0,02
U.S. Treasury STRIPS				
0,000 % fällig am 15.05.2046 (d)		2.200	882	0,05
			303.134	16,66
Summe USA			1.116.784	61,39
JUNGFERNINSELN (BRITISCH)				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
TSMC Global Ltd.				
1,250 % fällig am 23.04.2026		3.600	3.217	0,18
KURZFRISTIGE INSTRUMENTE				
COMMERCIAL PAPER				
AT+T, Inc.				
5,700 % fällig am 19.03.2024		1.550	1.484	0,08
Haleon UK Capital PLC				
5,520 % fällig am 24.07.2023		300	299	0,02
Humana, Inc.				
5,450 % fällig am 13.07.2023		400	399	0,02
Walgreens Boots Alliance				
6,000 % fällig am 05.07.2023		4.300	4.296	0,23
Summe kurzfristige Instrumente			6.478	0,35
Summe Übertragbare Wertpapiere			**$ 2.107.775**	**115,86**

PENSIONSGESCHÄFTE

Kontrahent	Kredit-zins	Abrechnungs-datum	Fälligkeits-datum	Kapital-betrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensions-geschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensions-geschäft[1]	% des Nettovermö-gens
SSB	2,400 %	30.06.2023	03.07.2023	$ 2.319	U.S. Treasury Notes 1,875 % fällig am 30.06.2026	$ (2.365)	$ 2.319	$ 2.319	0,13
Summe Pensionsgeschäfte						**$ (2.365)**	**$ 2.319**	**$ 2.319**	**0,13**

[1] Umfasst aufgelaufene Zinsen.

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

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

FUTURES

Beschreibung	Art	Ablauf-monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Australia Government 10-Year Bond September Futures	Long	09.2023	134	$ (57)	0,00
Canada Government 10-Year Bond September Futures	Long	09.2023	82	(111)	(0,01)
Euro-Bobl September Futures	Short	09.2023	335	393	0,02
Euro-Bund 10-Year Bond September Futures	Short	09.2023	599	657	0,04
Euro-Buxl 30-Year Bond September Futures	Short	09.2023	201	(527)	(0,03)
Euro-Schatz September Futures	Short	09.2023	514	465	0,03
Japan Government 10-Year Bond September Futures	Short	09.2023	23	(86)	0,00
U.S. Treasury 2-Year Note September Futures	Long	09.2023	394	(1.008)	(0,06)
U.S. Treasury 5-Year Note September Futures	Short	09.2023	112	175	0,01
U.S. Treasury 10-Year Note September Futures	Short	09.2023	562	1.122	0,06

Beschreibung	Art	Ablauf-monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
U.S. Treasury 10-Year Ultra September Futures	Short	09.2023	1.206	$ 1.169	0,06
U.S. Treasury 30-Year Bond September Futures	Long	09.2023	349	37	0,00
U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond September Futures	Short	09.2023	283	(544)	(0,03)
United Kingdom Long Gilt September Futures	Short	09.2023	164	187	0,01
				$ 1.872	0,10
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate				**$ 1.872**	**0,10**

DERIVATIVE OTC-FINANZINSTRUMENTE (Angaben in Tausend*)

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

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMMISSIONEN - SCHUTZKAUF[1]

Referenzeinheit	Zu bezahlender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag[3]	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Koninklijke KPN NV	(1,000) %	20.12.2023	€ 200	$ (5)	0,00

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMMISSIONEN - SCHUTZVERKAUF[2]

Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag[3]	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Ally Financial, Inc.	5,000 %	20.12.2027	$ 1.100	$ 25	0,00
American International Group, Inc.	1,000	20.12.2026	900	(8)	0,00
American International Group, Inc.	1,000	20.12.2027	1.000	17	0,00
AT&T, Inc.	1,000	20.12.2023	2.100	(21)	0,00
AT&T, Inc.	1,000	20.06.2026	2.500	(22)	0,00
AT&T, Inc.	1,000	20.06.2028	700	5	0,00
British Telecommunications PLC	1,000	20.12.2025	€ 100	0	0,00
British Telecommunications PLC	1,000	20.12.2027	300	4	0,00
British Telecommunications PLC	1,000	20.06.2028	1.600	4	0,00
British Telecommunications PLC	1,000	20.12.2028	400	2	0,00
Ford Motor Credit Co. LLC	5,000	20.06.2027	$ 600	8	0,00
General Electric Co.	1,000	20.06.2024	300	7	0,00
General Electric Co.	1,000	20.12.2024	800	20	0,00
Goldman Sachs Group, Inc.	1,000	20.12.2026	3.000	(4)	0,00
MetLife, Inc.	1,000	20.06.2028	1.700	30	0,00
Telefonica Emisiones S.A.	1,000	20.06.2028	€ 1.000	4	0,00
Tesco PLC	1,000	20.06.2028	600	(2)	0,00
Verizon Communications, Inc.	1,000	20.06.2026	$ 700	(11)	0,00
Verizon Communications, Inc.	1,000	20.12.2026	2.200	(37)	0,00
Verizon Communications, Inc.	1,000	20.12.2027	700	11	0,00
Verizon Communications, Inc.	1,000	20.06.2028	8.400	42	0,01
				$ 74	0,01

ZINSSWAPS

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Erhalt[4]	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	3,250 %	20.09.2053	£ 800	$ 72	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,750	15.06.2024	$ 40.600	(522)	(0,03)
Erhalt[4]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,785	12.08.2051	800	254	0,01
Zahlung	1-Year BRL-CDI	13,026	02.01.2025	BRL 243.200	1.188	0,06
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	1,000	16.06.2026	CAD 13.800	(865)	(0,05)
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	1,220	03.03.2025	600	(35)	0,00
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	1,235	04.03.2025	1.100	(65)	0,00
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	1,275	03.03.2025	600	(34)	0,00
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	1,276	03.03.2025	300	(17)	0,00
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	1,290	03.03.2025	200	(11)	0,00
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	1,500	17.06.2030	500	(37)	0,00
Zahlung	3-Month CAD-CAONREPO Compounded-OIS	4,000	21.06.2025	70.100	(428)	(0,02)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,785	12.08.2023	$ 800	4	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	0,600	15.12.2050	€ 2.300	1.192	0,07
Erhalt[4]	6-Month EUR-EURIBOR	2,500	20.09.2053	10.100	39	0,00
Zahlung[4]	6-Month EUR-EURIBOR	3,000	20.09.2028	81.400	192	0,01
Zahlung[4]	6-Month EUR-EURIBOR	3,000	20.09.2033	44.600	154	0,01
Zahlung[4]	6-Month EUR-EURIBOR	3,500	20.09.2025	10.500	5	0,00
Erhalt	CPURNSA	2,475	16.06.2031	$ 2.600	221	0,01
					$ 1.307	0,07
Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate					**$ 1.376**	**0,08**

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

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

(3) Der maximal mögliche Betrag, den der Fonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

(4) Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft.

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

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

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMMISSIONEN - SCHUTZVERKAUF[1]

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag[2]	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Markt-wert	% des Nettovermögens
BOA	Italy Government International Bond	1,000 %	20.12.2026	$ 2.300	$ 11	$ 15	$ 26	0,00

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

(2) Der maximal mögliche Betrag, den der Fonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung		Zu erhaltende Währung		Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	08.2023	AUD	5.653	$	3.822	$ 55	$ 0	$ 55	0,00
	08.2023	£	568		706	0	(16)	(16)	0,00
	08.2023	SEK	1.428		139	6	0	6	0,00
BPS	07.2023	€	458.971		493.426	2	(7.314)	(7.312)	(0,40)
	07.2023	$	526.823	€	480.789	0	(2.281)	(2.281)	(0,12)
	08.2023	€	476.359	$	522.680	2.260	0	2.260	0,12
	08.2023	ZAR	14.459		777	15	0	15	0,00
BRC	08.2023	£	11.013		13.817	0	(187)	(187)	(0,01)
	08.2023	$	6.010	¥	823.780	0	(274)	(274)	(0,01)
	08.2023	ZAR	17.495	$	947	24	0	24	0,00
CBK	07.2023	€	6.064		6.507	0	(109)	(109)	(0,01)
	07.2023	$	8.423	€	7.713	10	(18)	(8)	0,00
	08.2023	CAD	20.450	$	15.327	0	(137)	(137)	(0,01)
	08.2023	£	6.165		7.688	0	(152)	(152)	(0,01)
	08.2023	SEK	10.611		1.046	62	0	62	0,00
	08.2023	$	1.672	NOK	17.442	0	(42)	(42)	0,00
CLY	08.2023		1.888		19.785	0	(38)	(38)	0,00
GLM	08.2023		735		7.800	0	(6)	(6)	0,00
JPM	08.2023	£	36.672	$	46.447	0	(187)	(187)	(0,01)
	08.2023	$	188	¥	25.010	0	(14)	(14)	0,00
	08.2023		271	NOK	2.876	0	(2)	(2)	0,00
MBC	07.2023	€	25.133	$	26.955	0	(465)	(465)	(0,03)
	07.2023	$	1.021	€	931	0	(5)	(5)	0,00
	08.2023	CAD	398	$	300	0	(1)	(1)	0,00
	08.2023	£	2.022		2.538	0	(34)	(34)	0,00
MYI	07.2023	€	91		99	0	0	0	0,00
	07.2023	£	42		54	0	0	0	0,00
	07.2023	SEK	7.838		723	0	(2)	(2)	0,00
	07.2023	$	85	€	78	0	0	0	0,00
	07.2023		1.309	£	1.037	9	0	9	0,00
	08.2023		2.461	¥	327.013	0	(184)	(184)	(0,01)
SCX	07.2023		954	€	870	0	(4)	(4)	0,00
	08.2023	AUD	229	$	153	0	0	0	0,00
	08.2023	£	554		687	0	(18)	(18)	0,00
	08.2023	$	1.421	£	1.122	6	0	6	0,00
UAG	08.2023	£	32.122	$	40.601	0	(247)	(247)	(0,01)
	10.2023	ZAR	30.642		1.655	50	0	50	0,00
						$ 2.499	$ (11.737)	$ (9.238)	(0,51)

ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklassen Institutional CHF (Hedged) thesaurierend, Institutional CHF (Hedged) ausschüttend, Class E CHF (Hedged) thesaurierend und Class E CHF (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung		Zu erhaltende Währung		Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2023	CHF	15	$	17	$ 0	$ 0	$ 0	0,00
BPS	07.2023		65.476		73.211	25	0	25	0,00

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung		Zu erhaltende Währung		Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
	07.2023	$	97.835	CHF	88.514	$ 1.102	$ 0	$ 1.102	0,06
	08.2023		73.204		65.284	0	(25)	(25)	0,00
CLY	07.2023	CHF	34.604	$	38.523	0	(155)	(155)	(0,01)
	08.2023	$	38.523	CHF	34.505	155	0	155	0,01
JPM	07.2023		225		203	2	0	2	0,00
MBC	07.2023	CHF	56	$	62	0	0	0	0,00
	07.2023	$	316	CHF	283	1	0	1	0,00
MYI	07.2023	CHF	3.385	$	3.739	0	(44)	(44)	0,00
	07.2023	$	905	CHF	821	12	0	12	0,00
RYL	07.2023	CHF	4	$	4	0	0	0	0,00
SCX	07.2023	$	69.771	CHF	62.694	305	0	305	0,02
UAG	07.2023	CHF	67.696	$	75.519	0	(149)	(149)	(0,01)
	07.2023	$	63.933	CHF	57.441	272	0	272	0,01
	08.2023		75.472		67.461	148	0	148	0,01
						$ 2.022	$ (373)	$ 1.649	0,09

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklassen EUR (Hedged) thesaurierend, Institutional EUR (Hedged) ausschüttend, Investor EUR (Hedged) thesaurierend, Investor EUR (Hedged) ausschüttend, E Class EUR (Hedged) thesaurierend und E Class EUR (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung		Zu erhaltende Währung		Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2023	€	193	$	210	$ 0	$ 0	$ 0	0,00
	07.2023	$	318.337	€	296.209	4.828	0	4.828	0,27
BPS	07.2023	€	281.493	$	308.511	1.409	(6)	1.403	0,08
	07.2023	$	317.783	€	295.608	4.726	0	4.726	0,26
	08.2023		285.856		260.523	0	(1.237)	(1.237)	(0,07)
BRC	07.2023	€	58.828	$	63.633	0	(549)	(549)	(0,03)
CBK	07.2023		277.901		301.953	10	(1.248)	(1.238)	(0,07)
	07.2023	$	1.500	€	1.392	18	0	18	0,00
	08.2023		283.280		260.192	978	0	978	0,05
JPM	07.2023	€	261.055	$	285.046	235	0	235	0,01
	07.2023	$	318.471	€	297.868	6.504	0	6.504	0,36
	08.2023		285.445		261.055	0	(243)	(243)	(0,01)
MBC	07.2023	€	6.942	$	7.451	3	(126)	(123)	(0,01)
	07.2023	$	38.120	€	35.592	710	0	710	0,04
MYI	07.2023	€	58.582	$	63.565	0	(348)	(348)	(0,02)
SCX	07.2023	$	19.709	€	18.416	384	0	384	0,02
						$ 19.805	$ (3.757)	$ 16.048	0,88

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklassen Institutional GBP (Hedged) thesaurierend, Institutional GBP (Hedged) ausschüttend und Class E GBP (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung		Zu erhaltende Währung		Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2023	£	157	$	199	$ 0	$ 0	$ 0	0,00
	07.2023	$	38	£	30	0	0	0	0,00
BPS	07.2023	£	37	$	47	1	0	1	0,00
	07.2023	$	64.640	£	52.260	1.801	0	1.801	0,10
BRC	07.2023	£	179	$	225	0	(3)	(3)	0,00
	07.2023	$	291	£	234	6	0	6	0,00
CBK	07.2023	£	113	$	144	0	0	0	0,00
	07.2023	$	252	£	200	3	0	3	0,00
JPM	07.2023	£	52.214	$	66.020	0	(363)	(363)	(0,02)
	08.2023	$	66.034	£	52.214	362	0	362	0,02
MBC	07.2023	£	56	$	71	1	0	1	0,00
	07.2023	$	65.069	£	52.560	1.752	0	1.752	0,10
MYI	07.2023		64.210		51.663	1.472	0	1.472	0,08
						$ 5.398	$ (366)	$ 5.032	0,28

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklassen Institutional SEK (Hedged) thesaurierend und Administrative SEK (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung		Zu erhaltende Währung		Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2023	SEK	1.284.367	$	118.997	$ 99	$ (10)	$ 89	0,00
	07.2023	$	10.315	SEK	110.528	3	(85)	(82)	0,00
	08.2023		114.226		1.231.185	0	(98)	(98)	(0,01)
BRC	07.2023		114		1.217	0	(1)	(1)	0,00
CBK	07.2023		78.870		861.432	882	0	882	0,05
GLM	07.2023		444		4.789	0	(1)	(1)	0,00
MBC	07.2023		75.679		815.016	0	(224)	(224)	(0,01)
MYI	07.2023	SEK	1.233.246	$	114.226	50	0	50	0,00
	07.2023	$	106.212	SEK	1.140.146	0	(655)	(655)	(0,04)
	08.2023		114.226		1.231.716	0	(49)	(49)	0,00
SCX	07.2023	SEK	2.214	$	207	2	0	2	0,00
	07.2023	$	75.470	SEK	816.396	113	0	113	0,01
						$ 1.149	$ (1.123)	$ 26	0,00
Summe Freiverkehrsfinanzderivate								**$ 13.543**	**0,74**

LEERVERKAUFTE WERTPAPIERE

BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
US-REGIERUNGSBEHÖRDEN			
Uniform Mortgage-Backed Security, TBA			
3,000 % fällig am 01.08.2053	$ 6.700	$ (5.906)	(0,32)
4,500 % fällig am 01.08.2053	26.500	(25.492)	(1,41)
Summe Leerverkaufte Wertpapiere		**$ (31.398)**	**(1,73)**
Summe Anlagen		**$ 2.095.487**	**115,18**
Sonstige Aktiva und Passiva		**$ (276.138)**	**(15,18)**
Nettovermögen		**$ 1.819.349**	**100,00**

ERLÄUTERUNGEN ZUR AUFSTELLUNG DES WERTPAPIERBESTANDS (Angaben in Tausend*):

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

(a) **Bei dem Wertpapier handelt es sich um ein Interest Only- („IO“) bzw. IO-Strip.**

(b) **Wertpapier per Emissionstermin.**

(c) **Wertpapier mit Sachwertausschüttung.**

(d) **Nullkuponwertpapier.**

(e) **Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.**

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

(g) **Bedingt wandelbares Wertpapier.**

(h) **Eingeschränkte Wertpapiere (31. Dezember 2022: 0,87 %):**

Emittentenbeschreibung	Kupon	Fälligkeits-datum	Kauf-datum	Kosten	Markt-wert	% des Nettovermögens
AT&T, Inc.	4,850 %	25.05.2047	23.09.2021	$ 1.324	$ 1.015	0,06
Brookfield Property Finance ULC	7,125	13.02.2028	09.02.2023	820	770	0,04
Citigroup, Inc.	2,572	03.06.2031	29.12.2021	8.156	6.762	0,37
Citigroup, Inc.	5,746	25.01.2026	18.01.2022	2.000	1.992	0,11
Citigroup, Inc.	6,270	17.11.2033	04.04.2023	0	0	0,00
Deutsche Bank AG	1,447	01.04.2025	23.09.2021	2.003	1.901	0,11
Oracle Corp.	3,950	25.03.2051	22.03.2021	299	227	0,01
				$ 14.602	$ 12.667	0,70

(i) **Wertpapiere mit einem gesamten beizulegenden Zeitwert von 151.489 USD (31. Dezember 2022: 74.895 USD) wurden zum 30. Juni 2023 gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen als Sicherheit für Pensionsgeschäfte verpfändet.**

(j) **Wertpapiere mit einem gesamten beizulegenden Zeitwert von 30.629 USD (31. Dezember 2022: 22.792 USD) wurden zum 30. Juni 2023 gemäß den Rahmenverträgen als Sicherheit für Wertpapier-Termingeschäfte für verzögert gelieferte Wertpapiere oder Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte verpfändet oder geliefert.**

Barmittel in Höhe von 32.764 USD (31. Dezember 2022: 28.652 USD) wurden zum 30. Juni 2023 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Barmittel in Höhe von 1.390 USD (31. Dezember 2022: 1.380 USD) wurden zum 30. Juni 2023 gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. als Sicherheit für Finanzderivate verpfändet.

Beizulegender Zeitwert[1]

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 30. Juni 2023 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie[2]	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	$ 0	$ 2.107.775	$ 0	$ 2.107.775
Pensionsgeschäfte	0	2.319	0	2.319
Finanzderivate[3]	921	15.870	0	16.791
Leerverkaufte Wertpapiere	0	(31.398)	0	(31.398)
Summen	**$ 921**	**$ 2.094.566**	**$ 0**	**$ 2.095.487**

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

Kategorie[2]	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	$ 0	$ 1.489.771	$ 0	$ 1.489.771
Pensionsgeschäfte	0	15.240	0	15.240
Finanzderivate[3]	3.729	11.595	0	15.324
Leerverkaufte Wertpapiere	0	(5.887)	0	(5.887)
Summen	**$ 3.729**	**$ 1.510.719**	**$ 0**	**$ 1.514.448**

(1) Weitere Informationen finden Sie in den Erläuterungen in Erläuterung 3.

(2) Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung des Wertpapierbestands.

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

Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2023:

Kontrahent	Kredit-zins	Abrechnungs-datum	Fälligkeits-datum	Kredit-betrag	Verbindlichkeiten aus umgekehrten Pensions-geschäften	% des Nettovermögens
BOS	5,000 %	29.06.2023	03.07.2023	$ (6.749)	$ (6.751)	(0,37)
	5,180	15.06.2023	13.07.2023	(39.799)	(39.890)	(2,19)
	5,180	20.06.2023	13.07.2023	(90.619)	(90.763)	(4,99)
	5,190	16.06.2023	06.07.2023	(8.306)	(8.323)	(0,46)
	5,200	30.06.2023	06.07.2023	(5.684)	(5.685)	(0,31)
Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte					**$ (151.412)**	**(8,32)**

Ausstehende Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte zum 30. Juni 2023:

Kontrahent	Kredit-zins	Abrechnungs-datum	Fälligkeits-datum	Kredit-betrag	Zahlbar für Rückkauf-Finanzierungs-geschäfte[1]	% des Nettovermögens
BPG	4,900 %	28.06.2023	05.07.2023	$ (13.806)	$ (13.812)	(0,76)
	5,090	29.06.2023	06.07.2023	(10.036)	(10.039)	(0,55)
MSC	4,700	28.06.2023	05.07.2023	(6.980)	(6.982)	(0,38)
Summe Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte					**$ (30.833)**	**(1,69)**

(1) In dem für Rückkaufgeschäfte zahlbaren Betrag sind 18 USD für einen aufgeschobenen Kursrückgang enthalten.

Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC-Derivate und -Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2023 und 31. Dezember 2022:

	Zum 30. Jun. 2023			Zum 31. Dez. 2022		
Kontrahent	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-engagement[1]	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-engagement[1]
BOA	$ 4.808	$ (3.670)	$ 1.138	$ 631	$ (740)	$ (109)
BPS	478	0	478	1	0	1
BRC	(984)	770	(214)	524	(240)	284
CBK	257	0	257	7.658	(7.770)	(112)
CLY	(38)	0	(38)	k. A.	k. A.	k. A.
GLM	(7)	0	(7)	k. A.	k. A.	k. A.
JPM	6.294	(5.460)	834	(244)	0	(244)
MBC	1.612	(770)	842	(1.588)	1.380	(208)
MYI	261	620	881	312	(100)	212
SCX	788	(220)	568	4.744	(4.520)	224
UAG	74	0	74	1.133	(520)	613

(1) Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären.

Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung des Wertpapierbestands zum 30. Juni 2023:

	30. Jun. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	93,58	81,73
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	22,17	26,66
Sonstige übertragbare Wertpapiere	0,11	0,36
Pensionsgeschäfte	0,13	1,11
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	0,10	0,46
Zentral abgerechnete Finanzderivate	0,08	(0,30)
Freiverkehrsfinanzderivate	0,74	0,96
Leerverkaufte Wertpapiere	(1,73)	(0,43)
Umgekehrte Pensionsgeschäfte	(8,32)	(5,54)
Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte	(1,69)	(5,54)

Das Anlageportfolio des Fonds konzentriert sich zum 30. Juni 2023 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	30. Jun. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
Australien	0,85	0,41
Österreich	0,42	0,22
Belgien	1,37	0,65
Brasilien	k. A.	0,02
Kanada	1,97	1,75
Cayman-Inseln	0,10	0,27
Chile	0,37	0,44
Kolumbien	k. A.	0,09
Zypern	k. A.	0,08
Tschechische Republik	0,24	k. A.
Dänemark	0,87	0,79
Finnland	0,75	0,63
Frankreich	7,56	5,16
Deutschland	3,35	2,94
Guernsey, Kanalinseln	0,24	0,32
Hongkong	0,42	0,01

Anlagen zum Marktwert	30. Jun. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
Indien	0,66	0,96
Indonesien	0,04	k. A.
Irland	1,11	1,40
Israel	0,10	k. A.
Italien	1,65	1,33
Japan	3,90	3,85
Jersey, Kanalinseln	0,06	0,09
Luxemburg	0,99	1,23
Mauritius	0,25	0,18
Mexiko	0,31	0,32
Multinational	0,47	0,63
Niederlande	7,13	7,21
Norwegen	0,13	0,16
Peru	0,09	0,11
Philippinen	0,22	k. A.
Polen	0,08	k. A.
Rumänien	0,33	0,29
Serbien	0,09	0,13
Singapur	0,38	0,35
Südafrika	k. A.	0,02
Südkorea	2,10	1,02
Spanien	1,52	1,34
Supranational	2,87	2,90
Schweden	0,64	0,70
Schweiz	0,64	0,63
Thailand	0,01	k. A.
Großbritannien	9,66	8,14
USA	61,39	55,93
Jungferninseln (Britisch)	0,18	0,24
Kurzfristige Instrumente	0,35	5,81
Pensionsgeschäfte	0,13	1,11
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	0,10	0,46
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen - Schutzkauf	0,00	0,00
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	0,01	(0,02)
Zinsswaps	0,07	(0,28)
Freiverkehrsfinanzderivate		
Verkaufsoptionen		
Optionen auf Wertpapiere	k. A.	0,00
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	0,00	0,00
Devisenterminkontrakte	(0,51)	(0,50)
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	1,25	1,46
Leerverkaufte Wertpapiere	(1,73)	(0,43)
Sonstige Aktiva und Passiva	(15,18)	(10,55)
Nettovermögen	100,00	100,00

BESCHREIBUNG		PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE				
AUSTRALIEN				
STAATSEMISSIONEN				
Australia Government International Bond				
0,750 % fällig am 21.11.2027	AUD	13.036	$ 8.427	0,67
3,000 % fällig am 20.09.2025		6.306	4.328	0,35
Summe Australien			12.755	1,02
KANADA				
STAATSEMISSIONEN				
Canadian Government Real Return Bond				
4,250 % fällig am 01.12.2026 (a)	CAD	2.671	2.175	0,17
CAYMAN INSELN				
FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE				
Atlas Senior Loan Fund Ltd.				
6,410 % fällig am 16.01.2030	$	1.725	1.717	0,14
Carlyle Global Market Strategies CLO Ltd.				
6,360 % fällig am 15.10.2030		1.297	1.291	0,10
Sound Point CLO Ltd.				
6,210 % fällig am 15.04.2029		2.308	2.305	0,18
Summe Cayman Inseln			5.313	0,42
DÄNEMARK				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Jyske Realkredit A/S				
0,500 % fällig am 01.10.2053	DKK	19.539	1.885	0,15
1,000 % fällig am 01.10.2050		18	2	0,00
1,000 % fällig am 01.10.2053		2.755	268	0,02
1,500 % fällig am 01.10.2050		492	53	0,00
1,500 % fällig am 01.10.2053		15.157	1.572	0,13
2,500 % fällig am 01.10.2047		3	0	0,00
Nordea Kredit Realkreditaktieselskab				
0,500 % fällig am 01.10.2043		10.543	1.169	0,09
1,000 % fällig am 01.10.2050		1	0	0,00
2,500 % fällig am 01.10.2047		13	2	0,00
Nykredit Realkredit A/S				
0,500 % fällig am 01.10.2053		3.009	290	0,02
1,000 % fällig am 01.10.2050		0	0	0,00
1,000 % fällig am 01.10.2053		0	0	0,00
1,500 % fällig am 01.10.2050		0	0	0,00
1,500 % fällig am 01.10.2053		126.999	13.792	1,10
2,000 % fällig am 01.10.2053		8.618	985	0,08
2,500 % fällig am 01.10.2047		2	0	0,00
3,000 % fällig am 01.10.2053		50.041	6.444	0,52
3,500 % fällig am 01.10.2053		3.205	429	0,04
5,000 % fällig am 01.10.2053		7.157	1.033	0,08
Realkredit Danmark A/S				
1,000 % fällig am 01.10.2050		7.471	787	0,06
1,000 % fällig am 01.10.2053		6.306	657	0,05
1,500 % fällig am 01.10.2050		16.225	1.740	0,14
1,500 % fällig am 01.10.2053		0	0	0,00
2,500 % fällig am 01.04.2047		8	1	0,00
3,000 % fällig am 01.10.2053		26.867	3.462	0,28
			34.571	2,76
STAATSEMISSIONEN				
Denmark Government International Bond				
0,100 % fällig am 15.11.2023 (a)		13.335	1.956	0,16
Summe Dänemark			36.527	2,92
FRANKREICH				
STAATSEMISSIONEN				
France Government International Bond				
0,100 % fällig am 01.03.2025 (a)	€	10.156	10.881	0,87
0,100 % fällig am 01.03.2026 (a)		3.970	4.245	0,34
0,100 % fällig am 01.03.2028 (a)		14.334	15.354	1,23
0,100 % fällig am 01.03.2029 (a)		590	626	0,05
0,100 % fällig am 25.07.2031 (a)		8.070	8.560	0,68
0,100 % fällig am 25.07.2036 (a)		241	247	0,02
0,100 % fällig am 25.07.2038 (a)		230	234	0,02
0,250 % fällig am 25.07.2024 (a)		15.310	16.548	1,32
0,550 % fällig am 01.03.2039 (a)		2.981	3.245	0,26
1,850 % fällig am 25.07.2027 (a)		14.015	16.071	1,28
2,100 % fällig am 25.07.2023 (a)		11.654	12.701	1,01
Summe Frankreich			88.712	7,08

BESCHREIBUNG		PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
DEUTSCHLAND				
STAATSEMISSIONEN				
Bundesrepublik Deutschland				
0,100 % fällig am 15.04.2026 (a)	€	20.992	$ 22.392	1,79
0,500 % fällig am 15.04.2030 (a)		24.514	27.270	2,17
Summe Deutschland			49.662	3,96
IRLAND				
FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE				
Adagio CLO DAC				
4,541 % fällig am 20.07.2036		5.100	5.564	0,44
Ares European CLO DAC				
3,787 % fällig am 15.04.2030		5.606	5.999	0,48
3,957 % fällig am 15.10.2031		4.200	4.504	0,36
Aurium CLO DAC				
4,618 % fällig am 23.03.2032		1.700	1.827	0,14
Bain Capital Euro CLO DAC				
3,980 % fällig am 20.04.2032		384	413	0,03
Cairn CLO DAC				
3,957 % fällig am 15.10.2031		1.700	1.818	0,14
4,212 % fällig am 20.10.2028		95	104	0,01
Carlyle Euro CLO DAC				
3,877 % fällig am 15.01.2031		796	851	0,07
Fidelity Grand Harbour CLO DAC				
4,726 % fällig am 15.03.2032		3.480	3.732	0,30
Harvest CLO DAC				
4,027 % fällig am 15.01.2032		1.600	1.708	0,14
Jubilee CLO DAC				
4,326 % fällig am 15.12.2029		250	269	0,02
Palmer Square European Loan Funding DAC				
4,227 % fällig am 15.10.2031		5.551	5.966	0,48
Palmerston Park CLO DAC				
3,825 % fällig am 18.04.2030		1.060	1.141	0,09
St. Paul's CLO DAC				
4,091 % fällig am 25.04.2030		4.979	5.349	0,43
			39.245	3,13
NON-AGENCY-MBS				
European Loan Conduit DAC				
4,358 % fällig am 17.02.2030		1.242	1.327	0,10
Glenbeigh Issuer DAC				
4,350 % fällig am 24.06.2050		5.425	5.890	0,47
Primrose Residential DAC				
4,189 % fällig am 24.03.2061		3.333	3.612	0,29
Shamrock Residential DAC				
4,289 % fällig am 24.12.2059		1.944	2.101	0,17
4,689 % fällig am 24.02.2071		2.960	3.210	0,26
			16.140	1,29
Summe Irland			55.385	4,42
ITALIEN				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
UniCredit SpA				
3,375 % fällig am 31.01.2027		4.100	4.414	0,35
STAATSEMISSIONEN				
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro				
0,400 % fällig am 15.05.2030 (a)		3.557	3.550	0,28
0,650 % fällig am 15.05.2026 (a)		3.740	3.950	0,32
1,400 % fällig am 26.05.2025 (a)		41.050	44.347	3,54
2,350 % fällig am 15.09.2024 (a)		34.059	37.400	2,98
2,400 % fällig am 15.05.2039 (a)		11.223	12.848	1,03
2,600 % fällig am 15.09.2023 (a)		11.191	12.206	0,97
			114.301	9,12
Summe Italien			118.715	9,47
JAPAN				
STAATSEMISSIONEN				
Japan Government International Bond				
0,005 % fällig am 10.03.2031 (a)	¥	190.289	1.412	0,11
0,100 % fällig am 10.09.2024 (a)		586.850	4.174	0,33
0,100 % fällig am 10.03.2025 (a)		1.382.217	9.874	0,79
0,100 % fällig am 10.03.2026 (a)		2.872.970	20.821	1,66
0,100 % fällig am 10.03.2028 (a)		1.592.571	11.614	0,93
0,100 % fällig am 10.03.2029 (a)	¥	2.252.462	$ 16.496	1,32
Summe Japan			64.391	5,14

BESCHREIBUNG		PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
LUXEMBURG				
KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG				
Delos Finance SARL				
7,288 % fällig am 06.10.2023	$	70	70	0,01
NON-AGENCY-MBS				
Miravet SARL				
4,265 % fällig am 26.05.2065	€	2.008	2.157	0,17
Summe Luxemburg			2.227	0,18
NIEDERLANDE				
NON-AGENCY-MBS				
Dutch Property Finance BV				
4,168 % fällig am 28.04.2064		1.876	2.052	0,16
Eurosail BV				
4,677 % fällig am 17.10.2040		438	478	0,04
Summe Niederlande			2.530	0,20
NEUSEELAND				
STAATSEMISSIONEN				
New Zealand Government International Bond				
2,000 % fällig am 20.09.2025	NZ	10.208	6.245	0,50
3,000 % fällig am 20.09.2030		1.268	812	0,06
Summe Neuseeland			7.057	0,56
PERU				
STAATSEMISSIONEN				
Peru Government International Bond				
5,940 % fällig am 12.02.2029	PE	700	190	0,02
SLOWENIEN				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Nova Ljubljanska Banka d.d.				
3,400 % fällig am 05.02.2030	€	600	556	0,05
SPANIEN				
FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE				
BBVA Consumer Auto				
0,270 % fällig am 20.07.2031		276	293	0,03
STAATSEMISSIONEN				
Spain Government International Bond				
0,700 % fällig am 30.11.2033 (a)		4.452	4.651	0,37
Summe Spanien			4.944	0,40
SCHWEDEN				
STAATSEMISSIONEN				
Sweden Government International Bond				
0,125 % fällig am 01.06.2026	SEK	49.488	4.451	0,35
0,125 % fällig am 01.12.2027		5.280	472	0,04
1,000 % fällig am 01.06.2025		63.760	5.866	0,47
Summe Schweden			10.789	0,86
SCHWEIZ				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Credit Suisse AG				
5,464 % fällig am 02.02.2024	$	1.650	1.637	0,13
UBS Group AG				
4,177 % fällig am 16.01.2026	€	600	645	0,05
6,537 % fällig am 12.08.2033	$	750	769	0,06
Summe Schweiz			3.051	0,24
GROSSBRITANNIEN				
NON-AGENCY-MBS				
Alba PLC				
5,191 % fällig am 17.03.2039	£	815	996	0,08
Atlas Funding PLC				
5,432 % fällig am 25.07.2058		2.102	2.670	0,21

BESCHREIBUNG		PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
Canada Square Funding PLC				
5,316 % fällig am 17.01.2059	£	3.849	$ 4.865	0,39
5,682 % fällig am 17.06.2058		1.713	2.166	0,17
5,852 % fällig am 17.06.2058		1.415	1.791	0,14
Canterbury Finance PLC				
5,377 % fällig am 16.05.2058		487	618	0,05
Eurosail PLC				
3,619 % fällig am 13.03.2045	€	730	786	0,06
3,736 % fällig am 10.06.2044		739	799	0,06
3,736 % fällig am 10.09.2044		983	1.060	0,08
5,140 % fällig am 13.03.2045	£	905	1.138	0,09
Great Hall Mortgages PLC				
5,152 % fällig am 18.03.2039		18	23	0,00
5,172 % fällig am 18.06.2038		450	568	0,05
London Wall Mortgage Capital PLC				
5,502 % fällig am 15.05.2052		983	1.240	0,10
Polaris PLC				
5,640 % fällig am 23.10.2059		2.802	3.538	0,28
6,154 % fällig am 27.05.2057		689	877	0,07
Precise Mortgage Funding PLC				
5,657 % fällig am 16.10.2056		268	340	0,03
6,065 % fällig am 12.12.2055		1.173	1.496	0,12
RMAC Securities PLC				
5,134 % fällig am 12.06.2044		1.495	1.824	0,15
Rochester Financing PLC				
5,602 % fällig am 18.12.2044		2.951	3.707	0,30
Stratton BTL Mortgage Funding PLC				
5,221 % fällig am 20.01.2054		4.047	5.119	0,41
Stratton Mortgage Funding PLC				
5,765 % fällig am 12.03.2052		754	955	0,08
Towd Point Mortgage Funding PLC				
5,841 % fällig am 20.07.2045		2.174	2.766	0,22
6,546 % fällig am 20.02.2054		562	715	0,06
Tower Bridge Funding PLC				
5,527 % fällig am 20.11.2063		2.222	2.811	0,22
5,629 % fällig am 20.12.2063		1.389	1.758	0,14
5,991 % fällig am 20.10.2064		4.500	5.753	0,46
Tudor Rose Mortgages				
5,509 % fällig am 20.06.2048		1.516	1.917	0,15
Twin Bridges PLC				
6,115 % fällig am 12.12.2054		2.197	2.799	0,22
			55.095	4,39
STAATSEMISSIONEN				
United Kingdom Gilt				
0,125 % fällig am 22.03.2024 (a)		43.714	54.507	4,35
0,125 % fällig am 22.03.2026 (a)		203	249	0,02
0,125 % fällig am 22.11.2036 (a)		1.146	1.346	0,11
0,125 % fällig am 22.11.2056 (a)		554	556	0,04
0,625 % fällig am 22.11.2042 (a)		1.526	1.845	0,15
0,625 % fällig am 22.03.2045 (a)		819	962	0,08
0,625 % fällig am 22.10.2050		1.900	982	0,08
1,250 % fällig am 22.11.2027 (a)	£	59.804	$ 76.806	6,13
4,250 % fällig am 07.12.2049		3.200	3.934	0,31
			141.187	11,27
Summe Großbritannien			196.282	15,66
USA				
FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE				
Aegis Asset-Backed Securities Trust Mortgage Pass-Through Certificates				
6,050 % fällig am 25.10.2034	$	456	455	0,04
Asset-Backed Securities Corp. Home Equity Loan Trust				
3,405 % fällig am 25.03.2036		26	26	0,00
Fremont Home Loan Trust				
5,885 % fällig am 25.07.2035		1	1	0,00
Renaissance Home Equity Loan Trust				
6,090 % fällig am 25.05.2034		1.925	1.733	0,14
Structured Asset Investment Loan Trust				
6,100 % fällig am 25.10.2033		776	753	0,06
			2.968	0,24
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Sabine Pass Liquefaction LLC				
5,750 % fällig am 15.05.2024		200	200	0,02
NON-AGENCY-MBS				
Merrill Lynch Mortgage Investors Trust				
5,690 % fällig am 25.08.2036		0	0	0,00
5,790 % fällig am 25.10.2028		6	5	0,00
Structured Asset Mortgage Investments Trust				
5,626 % fällig am 19.04.2035		285	258	0,02
5,646 % fällig am 19.07.2035		48	44	0,00
WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust				
5,730 % fällig am 25.07.2045		398	371	0,03
5,790 % fällig am 25.07.2045		76	72	0,01
			750	0,06
US-REGIERUNGSBEHÖRDEN				
Ginnie Mae				
3,858 % fällig am 20.08.2068		1.085	1.057	0,08
5,452 % fällig am 20.08.2066		184	184	0,01
5,866 % fällig am 20.08.2072 - 20.04.2073		10.089	9.994	0,80
5,966 % fällig am 20.10.2072		5.037	4.991	0,40
6,067 % fällig am 20.03.2073		5.700	5.636	0,45
6,166 % fällig am 20.05.2073		3.200	3.203	0,26
Uniform Mortgage-Backed Security				
4,500 % fällig am 01.09.2052		19.690	18.946	1,51
Uniform Mortgage-Backed Security, TBA				
4,000 % fällig am 01.08.2053		30.500	28.650	2,29
4,500 % fällig am 01.08.2053		37.700	36.265	2,89
			108.926	8,69
US-SCHATZOBLIGATIONEN				
U.S. Treasury Inflation Protected Securities (a)				
0,125 % fällig am 15.07.2024	$	34.617	$ 33.583	2,68
0,125 % fällig am 15.10.2024 (c)		56.509	54.512	4,35
0,125 % fällig am 15.04.2025 (d)		54.685	52.030	4,15
0,125 % fällig am 15.10.2025		52.370	49.658	3,96
0,125 % fällig am 15.04.2026 (c)		53.237	49.930	3,98
0,125 % fällig am 15.07.2026 (c)		77.561	72.873	5,82
0,125 % fällig am 15.10.2026 (c)		70.151	65.598	5,23
0,125 % fällig am 15.04.2027		22.452	20.787	1,66
0,125 % fällig am 15.01.2030		2.240	2.010	0,16
0,125 % fällig am 15.07.2030		7.335	6.581	0,53
0,125 % fällig am 15.07.2031		4.844	4.297	0,34
0,125 % fällig am 15.01.2032		1.641	1.446	0,12
0,125 % fällig am 15.02.2051		350	234	0,02
0,250 % fällig am 15.01.2025 (c)		92.331	88.522	7,06
0,250 % fällig am 15.02.2050		472	330	0,03
0,375 % fällig am 15.07.2025 (d)		57.812	55.332	4,42
0,375 % fällig am 15.01.2027 (c)		69.186	64.934	5,18
0,375 % fällig am 15.07.2027		47.738	44.763	3,57
0,500 % fällig am 15.01.2028 (c)		55.211	51.660	4,12
0,625 % fällig am 15.01.2024		31	31	0,00
0,625 % fällig am 15.01.2026 (c)		72.033	68.699	5,48
0,625 % fällig am 15.07.2032 (c)		6.368	5.856	0,47
0,750 % fällig am 15.07.2028		36.371	34.477	2,75
0,750 % fällig am 15.02.2045		1.932	1.598	0,13
0,875 % fällig am 15.01.2029		26.066	24.683	1,97
0,875 % fällig am 15.02.2047		754	633	0,05
1,375 % fällig am 15.02.2044		1.171	1.104	0,09
1,625 % fällig am 15.10.2027 (c)		63.482	62.569	4,99
2,125 % fällig am 15.02.2041		831	892	0,07
			919.622	73,38
Summe USA			1.032.466	82,39
KURZFRISTIGE INSTRUMENTE				
COMMERCIAL PAPER				
AT+T, Inc.				
5,700 % fällig am 19.03.2024		3.800	3.638	0,29
Summe kurzfristige Instrumente			3.638	0,29
Summe Übertragbare Wertpapiere			**$ 1.697.365**	**135,45**
		AKTIEN		
INVESTMENTFONDS				
ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN				
PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (b)		18.999	189	0,02
Summe Investmentfonds			**$ 189**	**0,02**

PENSIONSGESCHÄFTE

Kontrahent	Kredit-zins	Abrechnungs-datum	Fälligkeits-datum	Kapital-betrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensions-geschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensions-geschäft[1]	% des Nettovermögens
FICC	2,400 %	30.06.2023	03.07.2023	$ 7.529	U.S. Treasury Notes 4,625 % fällig am 30.06.2025	$ (7.680)	$ 7.529	$ 7.530	0,60
Summe Pensionsgeschäfte						**$ (7.680)**	**$ 7.529**	**$ 7.530**	**0,60**

[1] Umfasst aufgelaufene Zinsen.

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

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

FUTURES

Beschreibung	Art	Ablauf-monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Australia Government 10-Year Bond September Futures	Short	09.2023	16	$ 6	0,00
Euro-Bobl September Futures	Long	09.2023	326	(565)	(0,05)
Euro-BTP Italy Government Bond September Futures	Short	09.2023	84	(86)	(0,01)

Beschreibung	Art	Ablauf-monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Euro-BTP Italy Government Bond September Futures	Short	09.2023	110	$ 118	0,01
Euro-Bund 10-Year Bond September Futures	Short	09.2023	476	468	0,04
Euro-Buxl 30-Year Bond September Futures	Short	09.2023	56	(122)	(0,01)
Euro-OAT France Government 10-Year Bond September Futures	Long	09.2023	61	(6)	0,00
Euro-Schatz September Futures	Short	09.2023	1.342	1.323	0,11
Japan Government 10-Year Bond September Futures	Short	09.2023	37	(133)	(0,01)
U.S. Treasury 2-Year Note September Futures	Long	09.2023	16	0	0,00
U.S. Treasury 5-Year Note September Futures	Short	09.2023	1.181	1.661	0,13
U.S. Treasury 10-Year Note September Futures	Long	09.2023	291	(275)	(0,02)
U.S. Treasury 10-Year Ultra September Futures	Short	09.2023	543	411	0,03
U.S. Treasury 30-Year Bond September Futures	Long	09.2023	51	(3)	0,00
U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond September Futures	Short	09.2023	173	(341)	(0,03)
United Kingdom Long Gilt September Futures	Short	09.2023	222	92	0,01
				$ 2.548	0,20

VERKAUFSOPTIONEN

OPTIONEN AUF BÖRSENGEHANDELTE TERMINKONTRAKTE

Beschreibung	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Anzahl der Kontrakte	Aufgeld	Markt-wert	% des Nettovermögens
Put - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note August Futures	$ 113,000	21.07.2023	214	$ (151)	$ (238)	(0,02)
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate					**$ 2.310**	**0,18**

ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)

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

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMMISSIONEN - SCHUTZVERKAUF[1]

Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag[2]	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
General Electric Co.	1,000 %	20.12.2023	$ 500	$ (5)	0,00

ZINSSWAPS

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Erhalt[3]	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	3,250 %	20.09.2053	£ 1.900	$ 170	0,01
Zahlung[3]	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	4,000	20.09.2025	34.500	(1.272)	(0,10)
Erhalt	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	4,670	10.01.2033	4.100	62	0,01
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,000	16.06.2029	¥ 3.582.000	(260)	(0,02)
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,435	20.06.2029	1.418.000	(70)	(0,01)
Zahlung[3]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,880	25.01.2052	$ 4.300	(1.205)	(0,10)
Zahlung[3]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,888	21.11.2053	2.400	(605)	(0,05)
Erhalt[3]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,865	13.02.2054	17.200	369	0,03
Zahlung[3]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,085	13.02.2034	44.400	(798)	(0,06)
Erhalt[3]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,250	20.12.2053	1.900	(3)	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,400	23.02.2033	2.700	(40)	0,00
Zahlung[3]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,500	20.12.2033	7.300	(58)	0,00
Erhalt[3]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	4,250	20.12.2025	68.600	412	0,03
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,880	25.07.2023	4.300	(17)	0,00
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	0,550	10.08.2024	€ 2.200	(98)	(0,01)
Erhalt[3]	6-Month EUR-EURIBOR	2,500	20.09.2053	32.500	(540)	(0,04)
Zahlung[3]	6-Month EUR-EURIBOR	3,000	20.09.2028	16.300	40	0,00
Zahlung[3]	6-Month EUR-EURIBOR	3,000	20.09.2033	79.500	126	0,01
Erhalt[3]	6-Month EUR-EURIBOR	3,500	20.09.2025	53.200	(28)	0,00
Erhalt	CPTFEMU	1,005	15.02.2025	18.100	1.802	0,14
Zahlung	CPTFEMU	1,355	15.02.2050	1.200	(135)	(0,01)
Zahlung	CPTFEMU	1,375	15.02.2040	1.600	(213)	(0,02)
Erhalt	CPTFEMU	1,380	15.03.2031	4.800	593	0,05
Erhalt	CPTFEMU	1,500	15.07.2031	7.040	901	0,07
Zahlung	CPTFEMU	1,946	15.03.2048	800	(193)	(0,02)
Erhalt	CPTFEMU	2,359	15.08.2030	1.500	75	0,01
Zahlung	CPTFEMU	2,421	15.05.2052	330	(54)	0,00
Erhalt	CPTFEMU	2,470	15.07.2032	1.600	78	0,01
Zahlung	CPTFEMU	2,488	15.05.2037	2.290	(175)	(0,01)
Erhalt	CPTFEMU	2,550	15.04.2052	300	45	0,00
Erhalt	CPTFEMU	2,570	15.06.2032	1.200	51	0,00
Zahlung	CPTFEMU	2,580	15.03.2052	1.400	(185)	(0,01)
Zahlung	CPTFEMU	2,590	15.12.2052	1.700	(97)	(0,01)
Erhalt	CPTFEMU	2,600	15.05.2032	3.000	140	0,01
Zahlung	CPTFEMU	2,700	15.04.2053	5.500	(10)	0,00
Erhalt	CPTFEMU	2,720	15.06.2032	1.800	58	0,00
Erhalt	CPTFEMU	2,975	15.08.2027	19.700	226	0,02
Erhalt	CPTFEMU	3,000	15.05.2027	5.400	137	0,01
Erhalt	CPTFEMU	3,130	15.05.2027	100	3	0,00

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Zahlung	CPTFEMU	3,520 %	15.09.2024	€ 5.200	$ (56)	0,00
Zahlung	CPTFEMU	3,720	15.09.2024	3.300	(23)	0,00
Zahlung	CPTFEMU	3,850	15.09.2024	7.700	(48)	0,00
Erhalt	CPURNSA	1,794	24.08.2027	$ 6.700	168	0,01
Erhalt	CPURNSA	1,798	25.08.2027	3.400	86	0,01
Zahlung	CPURNSA	1,883	20.11.2029	7.400	(202)	(0,02)
Erhalt	CPURNSA	1,890	27.08.2027	6.500	167	0,01
Zahlung	CPURNSA	1,954	03.06.2029	4.700	(132)	(0,01)
Zahlung	CPURNSA	1,998	25.07.2029	4.300	(124)	(0,01)
Erhalt	CPURNSA	2,311	24.02.2031	6.600	208	0,02
Zahlung	CPURNSA	2,335	05.02.2028	6.110	(195)	(0,02)
Zahlung	CPURNSA	2,353	09.05.2028	960	(31)	0,00
Zahlung	CPURNSA	2,364	10.05.2028	7.960	(257)	(0,02)
Zahlung	CPURNSA	2,379	09.07.2028	1.900	(62)	(0,01)
Erhalt	CPURNSA	2,419	05.03.2026	400	12	0,00
Erhalt	CPURNSA	2,690	01.06.2026	1.300	38	0,00
Erhalt	CPURNSA	2,703	25.05.2026	2.450	72	0,01
Erhalt	CPURNSA	2,768	13.05.2026	3.500	104	0,01
Erhalt	CPURNSA	2,813	14.05.2026	1.600	48	0,00
Zahlung	FRCPXTOB	1,280	15.11.2034	€ 1.700	(225)	(0,02)
Zahlung	FRCPXTOB	1,410	15.11.2039	2.000	(291)	(0,02)
Zahlung	UKRPI	3,330	15.01.2025	£ 400	(55)	0,00
Zahlung	UKRPI	3,346	15.05.2030	550	(55)	0,00
Zahlung	UKRPI	3,530	15.10.2031	7.260	(875)	(0,07)
Zahlung	UKRPI	3,566	15.03.2036	1.400	(62)	(0,01)
Zahlung	UKRPI	3,850	15.09.2024	2.500	(364)	(0,03)
Erhalt	UKRPI	4,125	15.09.2032	480	24	0,00
Erhalt	UKRPI	4,130	15.09.2032	2.120	106	0,01
Zahlung	UKRPI	4,288	15.02.2032	2.200	(124)	(0,01)
Erhalt	UKRPI	4,480	15.09.2023	1.300	182	0,01
Erhalt	UKRPI	5,330	15.06.2024	8.800	386	0,03
Erhalt	UKRPI	6,440	15.05.2024	1.500	104	0,01
Erhalt	UKRPI	6,600	15.05.2024	2.200	143	0,01
					$ (2.101)	(0,17)
Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate					**$ (2.106)**	**(0,17)**

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

(2) Der maximal mögliche Betrag, den der Fonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

(3) Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft.

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

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

OPTIONSKAUF

ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag[1]	Kosten	Markt-wert	% des Nettovermögens
DUB	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Receive	2,237 %	17.11.2023	8.700	$ 540	$ 1.909	0,15

VERKAUFSOPTIONEN

INFLATION-CAPPED OPTIONS

Kontrahent	Beschreibung	Anfänglicher Index	Variabler Zinssatz	Verfalls-datum	Nenn-betrag[1]	Aufgeld	Markt-wert	% des Nettovermögens
GLM	Cap - OTC CPALEMU	$ 100,151	Maximal [(Index Final/Index Initial - 1) - 3,000 %] oder 0	22.06.2035	1.500	$ (68)	$ (85)	(0,01)
JPM	Cap - OTC CPURNSA	233,916	Maximal [(Index Final/Index Initial - 1) - 4,000 %] oder 0	22.04.2024	1.000	(7)	0	0,00
	Cap - OTC CPURNSA	234,781	Maximal [(Index Final/Index Initial - 1) - 4,000 %] oder 0	16.05.2024	100	(1)	0	0,00
						$ (76)	$ (85)	(0,01)

ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag[1]	Aufgeld	Markt-wert	% des Nettovermögens
BPS	Call - OTC 2-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,750 %	12.09.2023	33.600	$ (95)	$ (39)	0,00
DUB	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,340	17.11.2023	43.000	(542)	(3.171)	(0,25)
FAR	Call - OTC 2-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	4,420	21.09.2023	72.900	(415)	(312)	(0,03)
JPM	Call - OTC 2-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,750	12.09.2023	46.800	(131)	(54)	0,00
							$ (1.183)	$ (3.576)	(0,28)

(1) Der Nennbetrag stellt die Anzahl der Kontrakte dar.

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES - SCHUTZVERKAUF[1]

Kontrahent	Index/Tranchen	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag[2]	Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Markt-wert	% des Nettovermögens
GST	CMBX.NA.AAA.8 Index	0,500 %	17.10.2057	$ 600	$ (40)	$ 40	$ 0	0,00
SAL	CMBX.NA.AAA.12 Index	0,500	17.08.2061	1.400	(3)	(12)	(15)	0,00
UAG	CMBX.NA.AAA.9 Index	0,500	17.09.2058	894	(79)	77	(2)	0,00
					$ (122)	$ 105	$ (17)	0,00

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

(2) Der maximal mögliche Betrag, den der Fonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung		Zu erhaltende Währung		Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
AZD	07.2023	AUD	441	$	289	$ 0	$ (5)	$ (5)	0,00
	07.2023	$	1.606	AUD	2.420	5	0	5	0,00
	08.2023	AUD	2.420	$	1.607	0	(5)	(5)	0,00
BOA	07.2023		3.551		2.319	0	(45)	(45)	0,00
	07.2023	DKK	253.510		36.608	0	(537)	(537)	(0,04)
	07.2023	€	13.541		14.578	0	(195)	(195)	(0,02)
	07.2023	¥	202.000		1.452	55	0	55	0,00
	07.2023	NZD	2.917		1.770	0	(17)	(17)	0,00
	07.2023	SEK	45		4	0	0	0	0,00
	07.2023	$	17.228	DKK	117.135	0	(65)	(65)	(0,01)
	07.2023		3.593	£	2.841	19	0	19	0,00
	08.2023	DKK	116.939	$	17.228	65	0	65	0,01
BPS	07.2023	AUD	485		317	0	(6)	(6)	0,00
	07.2023	¥	8.169.087		58.798	2.278	0	2.278	0,18
	07.2023	NZD	69		42	0	(1)	(1)	0,00
	07.2023	$	1.146	AUD	1.730	6	0	6	0,00
	07.2023		333.069	€	303.979	0	(1.429)	(1.429)	(0,11)
	07.2023		2.284	£	1.794	0	(3)	(3)	0,00
	08.2023	AUD	1.730	$	1.147	0	(6)	(6)	0,00
	08.2023	€	303.979		333.537	1.442	0	1.442	0,11
CBK	07.2023	AUD	1.533		1.000	0	(20)	(20)	0,00
	07.2023	CAD	3.086		2.265	0	(67)	(67)	(0,01)
	07.2023	DKK	900		129	0	(3)	(3)	0,00
	07.2023	€	2.928		3.142	0	(52)	(52)	(0,01)
	07.2023	£	3.483		4.406	0	(22)	(22)	0,00
JPM	07.2023	AUD	3.411		2.230	0	(41)	(41)	0,00
	07.2023	$	19.934	¥	2.850.740	0	(210)	(210)	(0,02)
	08.2023	¥	2.838.626	$	19.934	211	0	211	0,02
	09.2023	PEN	9.795		2.660	0	(26)	(26)	0,00
MBC	07.2023	€	3.029		3.277	0	(28)	(28)	0,00
	07.2023	£	165.640		205.040	0	(5.547)	(5.547)	(0,44)
	07.2023	SEK	1.394		129	0	0	0	0,00
	07.2023	$	4.954	€	4.615	81	0	81	0,01
MYI	07.2023	£	59	$	75	1	(1)	0	0,00
	07.2023	NZD	194		117	0	(1)	(1)	0,00
	07.2023	SEK	107.609		10.025	62	0	62	0,00
	07.2023	$	15.314	DKK	104.463	0	(8)	(8)	0,00
	07.2023		1.626	€	1.492	1	0	1	0,00
	07.2023		1.767	£	1.400	13	0	13	0,00
	07.2023		10.116	SEK	109.217	0	(4)	(4)	0,00
	08.2023	DKK	104.289	$	15.314	8	0	8	0,00
	08.2023	SEK	109.082		10.116	4	0	4	0,00
RBC	07.2023	$	1.168	£	914	0	(6)	(6)	0,00
SCX	07.2023	AUD	4.816	$	3.147	0	(59)	(59)	(0,01)
	07.2023	NZD	7.598		4.613	0	(42)	(42)	0,00
	07.2023	$	2.359	AUD	3.554	6	0	6	0,00
	08.2023	AUD	3.554	$	2.361	0	(6)	(6)	0,00
SOG	07.2023		2.915		1.907	0	(33)	(33)	0,00
	07.2023	€	289.096		310.992	0	(4.412)	(4.412)	(0,35)
TOR	07.2023	AUD	1.543		1.009	0	(18)	(18)	0,00
	07.2023	$	2.889	AUD	4.374	23	0	23	0,00
	07.2023		2.332	CAD	3.086	2	(2)	0	0,00
	07.2023		203.428	£	160.091	104	0	104	0,01
	07.2023		38.333	¥	5.519.964	0	(142)	(142)	(0,01)
	07.2023		6.564	NZD	10.778	39	0	39	0,00
	08.2023	AUD	4.374	$	2.891	0	(23)	(23)	0,00
	08.2023	CAD	3.085		2.332	2	(2)	0	0,00
	08.2023	£	160.091		203.472	0	(100)	(100)	(0,01)
	08.2023	¥	5.496.554		38.333	143	0	143	0,01
	08.2023	NZD	10.778		6.563	0	(39)	(39)	0,00
UAG	07.2023	AUD	353		231	0	(4)	(4)	0,00
	07.2023	$	4.655	AUD	6.971	9	(24)	(15)	0,00
	08.2023	AUD	6.971	$	4.658	25	(10)	15	0,00
						$ 4.604	$ (13.266)	$ (8.662)	(0,69)

ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklasse Institutional CHF (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung		Zu erhaltende Währung		Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2023	CHF	60	$	66	$ 0	$ 0	$ 0	0,00
BPS	07.2023		4.263		4.766	2	0	2	0,00
	07.2023	$	6.484	CHF	5.865	72	0	72	0,01
	08.2023		4.766		4.250	0	(2)	(2)	0,00
MBC	07.2023	CHF	190	$	212	0	0	0	0,00
MYI	07.2023		192		212	0	(3)	(3)	0,00
	07.2023	$	2	CHF	1	0	0	0	0,00
RBC	07.2023	CHF	2	$	3	0	0	0	0,00
SCX	07.2023		39		44	0	0	0	0,00
	07.2023	$	4.688	CHF	4.212	20	0	20	0,00
UAG	07.2023	CHF	4.383	$	4.890	0	(10)	(10)	0,00
	07.2023	$	4.229	CHF	3.800	18	0	18	0,00
	08.2023		4.870		4.353	10	0	10	0,00
						$ 122	$ (15)	$ 107	0,01

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklassen Institutional EUR (Hedged) thesaurierend, Institutional EUR (Hedged) ausschüttend und Class E EUR (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung		Zu erhaltende Währung		Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2023	€	14.295	$	15.619	$ 25	$ (2)	$ 23	0,00
	07.2023	$	208.813	€	194.298	3.166	0	3.166	0,25
BPS	07.2023	€	191.441	$	209.717	876	(21)	855	0,07
	07.2023	$	209.584	€	194.960	3.118	0	3.118	0,25
	08.2023		191.522		174.549	0	(829)	(829)	(0,07)
CBK	07.2023	€	189.507	$	206.009	21	(764)	(743)	(0,06)
	08.2023	$	188.532	€	173.166	651	0	651	0,05
JPM	07.2023	€	173.166	$	189.080	156	0	156	0,01
	08.2023	$	189.345	€	173.166	0	(161)	(161)	(0,01)
MBC	07.2023	€	14.483	$	15.663	23	(161)	(138)	(0,01)
SOG	07.2023	$	209.726	€	194.960	2.975	0	2.975	0,24
						$ 11.011	$ (1.938)	$ 9.073	0,72

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklassen Institutional GBP (Hedged) thesaurierend und Institutional GBP (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung		Zu erhaltende Währung		Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2023	£	10.645	$	13.529	$ 0	$ (5)	$ (5)	0,00
	07.2023	$	126	£	100	1	0	1	0,00
BPS	07.2023		54.951		44.420	1.525	(2)	1.523	0,12
BRC	07.2023	£	1.645	$	2.084	2	(9)	(7)	0,00
	07.2023	$	50	£	41	1	0	1	0,00
CBK	07.2023	£	7.686	$	9.775	23	(19)	4	0,00
	07.2023	$	95	£	76	1	0	1	0,00
JPM	07.2023	£	33.814	$	42.754	0	(235)	(235)	(0,02)
	08.2023	$	42.763	£	33.814	235	0	235	0,02
MBC	07.2023	£	4.959	$	6.341	36	0	36	0,00
	07.2023	$	54.559	£	44.074	1.475	0	1.475	0,12
MYI	07.2023		54.675		43.992	1.253	0	1.253	0,10
RBC	07.2023	£	5.877	$	7.477	5	0	5	0,00
TOR	07.2023		34.384		43.692	0	(22)	(22)	0,00
	08.2023	$	43.702	£	34.384	22	0	22	0,00
						$ 4.579	$ (292)	$ 4.287	0,34

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklasse Institutional SGD (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung		Zu erhaltende Währung		Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BRC	07.2023	$	146.236	SGD	197.875	$ 0	$ (25)	$ (25)	0,00
GLM	07.2023		40.533		54.427	0	(316)	(316)	(0,02)
MBC	07.2023		133.531		180.414	0	(222)	(222)	(0,02)
SCX	07.2023		118.195		159.971	8	0	8	0,00
						$ 8	$ (563)	$ (555)	(0,04)

Summe Freiverkehrsfinanzderivate	**$ 2.481**	**0,20**
Summe Anlagen	**$ 1.707.768**	**136,28**
Sonstige Aktiva und Passiva	**$ (454.611)**	**(36,28)**
Nettovermögen	**$ 1.253.157**	**100,00**

ERLÄUTERUNGEN ZUR AUFSTELLUNG DES WERTPAPIERBESTANDS (Angaben in Tausend*):

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

(a) **Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.**

(b) **Mit dem Fonds verbunden.**

(c) **Wertpapiere mit einem gesamten beizulegenden Zeitwert von 408.709 USD (31. Dezember 2022: 183.180 USD) wurden zum 30. Juni 2023 gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen als Sicherheit für Pensionsgeschäfte verpfändet.**

(d) **Wertpapiere mit einem gesamten beizulegenden Zeitwert von 9.181 USD (31. Dezember 2022: 79.359 USD) wurden zum 30. Juni 2023 gemäß den Rahmenverträgen als Sicherheit für Wertpapier-Termingeschäfte für verzögert gelieferte Wertpapiere oder Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte verpfändet oder geliefert.**

Barmittel in Höhe von null USD (31. Dezember 2022: 286 USD) wurden zum 30. Juni 2023 gemäß den Rahmenverträgen für Wertpapier-Termingeschäfte als Sicherheit erhalten.

Barmittel in Höhe von 17.212 USD (31. Dezember 2022: 13.037 USD) wurden zum 30. Juni 2023 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Barmittel in Höhe von 6.410 USD (31. Dezember 2022: 5.380 USD) wurden zum 30. Juni 2023 gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. als Sicherheit für Finanzderivate verpfändet.

Beizulegender Zeitwert[1]

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 30. Juni 2023 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie[2]	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	$ 0	$ 1.691.697	$ 5.668	$ 1.697.365
Investmentfonds	189	0	0	189
Pensionsgeschäfte	0	7.529	0	7.529
Finanzderivate[3]	1.096	1.589	0	2.685
Summen	**$ 1.285**	**$ 1.700.815**	**$ 5.668**	**$ 1.707.768**

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

Kategorie[2]	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	$ 0	$ 1.661.693	$ 0	$ 1.661.693
Investmentfonds	12.424	0	0	12.424
Pensionsgeschäfte	0	1.053	0	1.053
Finanzderivate[3]	2.256	18.777	0	21.033
Summen	**$ 14.680**	**$ 1.681.523**	**$ 0**	**$ 1.696.203**

[1] Weitere Informationen finden Sie in den Erläuterungen in Erläuterung 3.

[2] Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung des Wertpapierbestands.

[3] Finanzderivate können offene Terminkontrakte, Swap-, Verkaufs- oder Kaufoptionen sowie Devisenterminkontrakte enthalten.

Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2023:

Kontrahent	Kredit-zins	Abrechnungs-datum	Fälligkeits-datum	Kredit-betrag	Verbindlichkeiten aus umgekehrten Pensions-geschäften	% des Nettovermögens
BOS	5,170 %	20.06.2023	13.07.2023	$ (65.967)	$ (66.071)	(5,27)
	5,170	21.06.2023	13.07.2023	(92.213)	(92.345)	(7,37)
	5,170	22.06.2023	13.07.2023	(73.094)	(73.189)	(5,84)
	5,180	15.06.2023	13.07.2023	(72.713)	(72.880)	(5,82)
	5,180	26.06.2023	17.07.2023	(20.757)	(20.772)	(1,66)
	5,180	30.06.2023	13.07.2023	(51.678)	(51.685)	(4,12)
	5,190	30.06.2023	03.07.2023	(13.640)	(13.642)	(1,09)
	5,220	30.06.2023	06.07.2023	(18.305)	(18.308)	(1,46)
Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte					**$ (408.892)**	**(32,63)**

Ausstehende Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte zum 30. Juni 2023:

Kontrahent	Kredit-zins	Abrechnungs-datum	Fälligkeits-datum	Kredit-betrag	Zahlbar für Rückkauf-Finanzierungs-geschäfte[1]	% des Nettovermögens
TDM	5,180 %	28.06.2023	12.07.2023	$ (3.193)	$ (3.194)	(0,26)
	5,200	29.06.2023	13.07.2023	(2.574)	(2.574)	(0,21)
	5,210	29.06.2023	06.07.2023	(3.442)	(3.444)	(0,27)
Summe Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte					**$ (9.212)**	**(0,74)**

[1] In dem für Rückkaufgeschäfte zahlbaren Betrag sind 12 USD für einen aufgeschobenen Kursrückgang enthalten.

Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC-Derivate und -Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2023 und 31. Dezember 2022:

	Zum 30. Jun. 2023			Zum 31. Dez. 2022		
Kontrahent	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-engagement[1]	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-engagement[1]
AZD	$ (5)	$ 10	$ 5	$ 1.129	$ (820)	$ 309
BOA	2.465	(2.050)	415	2.665	(2.510)	155
BPS	6.981	(6.190)	791	(530)	450	(80)
BRC	(31)	0	(31)	166	0	166
CBK	(251)	280	29	6.045	(6.000)	45
DUB	(1.262)	1.020	(242)	(1.270)	1.230	(40)
FAR	(312)	430	118	k. A.	k. A.	k. A.
GLM	(401)	290	(111)	1.583	(1.500)	83
GST	0	0	0	(1.050)	1.130	80
JPM	(125)	0	(125)	(314)	640	326
MBC	(4.343)	3.280	(1.063)	(485)	340	(145)
MYC	k. A.	k. A.	k. A.	(12)	30	18
MYI	1.325	(950)	375	(2.046)	1.530	(516)
RBC	(1)	0	(1)	317	(280)	37
RYL	k. A.	k. A.	k. A.	773	(450)	323
SAL	(15)	10	(5)	(11)	10	(1)
SCX	(73)	0	(73)	5.105	(4.920)	185
SOG	(1.470)	1.090	(380)	k. A.	k. A.	k. A.
TOR	(13)	0	(13)	31	(60)	(29)
UAG	12	0	12	(40)	20	(20)

[1] Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären.

Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung des Wertpapierbestands zum 30. Juni 2023:

	30. Jun. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	126,66	114,97
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	8,79	6,69
Sonstige übertragbare Wertpapiere	k. A.	0,13
Investmentfonds	0,02	0,91
Pensionsgeschäfte	0,60	0,08
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	0,18	0,26
Zentral abgerechnete Finanzderivate	(0,17)	0,40
Freiverkehrsfinanzderivate	0,20	0,88
Umgekehrte Pensionsgeschäfte	(32,63)	(19,18)
Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte	(0,74)	(5,83)

Das Anlageportfolio des Fonds konzentriert sich zum 30. Juni 2023 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	30. Jun. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
Australien	1,02	1,01
Kanada	0,17	0,16
Cayman-Inseln	0,42	0,55
Dänemark	2,92	3,10
Frankreich	7,08	5,15
Deutschland	3,96	4,63
Irland	4,42	3,76
Italien	9,47	6,49
Japan	5,14	5,03
Luxemburg	0,18	0,17
Niederlande	0,20	0,19
Neuseeland	0,56	0,52
Peru	0,02	0,09
Slowenien	0,05	0,04
Spanien	0,40	0,35
Schweden	0,86	0,82
Schweiz	0,24	k. A.
Großbritannien	15,66	14,56
USA	82,39	75,17
Kurzfristige Instrumente	0,29	k. A.
Investmentfonds	0,02	0,91
Pensionsgeschäfte	0,60	0,08
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	0,20	0,26
Verkaufsoptionen		
Optionen auf börsengehandelte Terminkontrakte	(0,02)	k. A.
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	0,00	0,00
Zinsswaps	(0,17)	0,40
Freiverkehrsfinanzderivate		
Optionskauf		
Zinsswapoptionen	0,15	0,27
Verkaufsoptionen		
Inflation-Capped Options	(0,01)	(0,01)
Zinsswapoptionen	(0,28)	(0,57)
Credit Default Swaps auf Kreditindizes— Schutzverkauf	0,00	0,00
Devisenterminkontrakte	(0,69)	(0,55)
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	1,03	1,74
Sonstige Aktiva und Passiva	(36,28)	(24,32)
Nettovermögen	100,00	100,00

BESCHREIBUNG		PAR (000S)		MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE					
AUSTRALIEN					
STAATSEMISSIONEN					
Australia Government International Bond					
0,250 % fällig am 21.11.2032	AUD	18.952	$	11.060	0,44
0,750 % fällig am 21.11.2027		19.495		12.601	0,50
2,000 % fällig am 21.08.2035		4.902		3.361	0,14
Summe Australien				27.022	1,08
BELGIEN					
STAATSEMISSIONEN					
Belgium Government International Bond					
1,400 % fällig am 22.06.2053	€	2.500		1.742	0,07
KANADA					
STAATSEMISSIONEN					
Canadian Government Real Return Bond					
0,500 % fällig am 01.12.2050 (b)	CAD	9.264		5.604	0,22
1,250 % fällig am 01.12.2047 (b)		11.769		8.527	0,34
1,500 % fällig am 01.12.2044 (b)		10.875		8.224	0,33
3,000 % fällig am 01.12.2036 (b)		4.251		3.786	0,15
4,000 % fällig am 01.12.2031 (b)		12.833		11.585	0,46
Summe Kanada				37.726	1,50
CAYMAN INSELN					
FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE					
BlueMountain CLO Ltd.					
6,340 % fällig am 15.07.2031	$	3.600		3.553	0,14
Catamaran CLO Ltd.					
6,373 % fällig am 22.04.2030		6.527		6.488	0,26
Denali Capital CLO Ltd.					
6,310 % fällig am 15.04.2031		498		491	0,02
Greystone Commercial Real Estate Notes Ltd.					
6,373 % fällig am 15.09.2037		4.732		4.669	0,19
Magnetite Ltd.					
6,240 % fällig am 15.04.2031		589		586	0,02
OZLM Ltd.					
6,348 % fällig am 16.05.2030		4.517		4.485	0,18
Regatta Funding Ltd.					
6,330 % fällig am 17.07.2031		6.000		5.947	0,24
Starwood Commercial Mortgage Trust					
6,296 % fällig am 15.07.2038		3.255		3.228	0,13
Venture CLO Ltd.					
6,311 % fällig am 07.09.2030		1.121		1.112	0,04
6,350 % fällig am 20.01.2029		2.747		2.728	0,11
Voya CLO Ltd.					
6,162 % fällig am 18.01.2029		1.536		1.529	0,06
Summe Cayman Inseln				34.816	1,39
DÄNEMARK					
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL					
DLR Kredit A/S					
1,000 % fällig am 01.10.2050	DKK	3.349		361	0,02
Jyske Realkredit A/S					
1,000 % fällig am 01.10.2050		49		5	0,00
1,000 % fällig am 01.10.2053		12		1	0,00
1,500 % fällig am 01.10.2050		37		4	0,00
1,500 % fällig am 01.10.2053		8.549		943	0,04
2,500 % fällig am 01.10.2047		3		0	0,00
Nordea Kredit Realkreditaktieselskab					
0,500 % fällig am 01.10.2043		27.907		3.094	0,12
0,500 % fällig am 01.10.2053		0		0	0,00
1,000 % fällig am 01.10.2050		3.069		304	0,01
1,500 % fällig am 01.10.2053		119.227		12.607	0,50
2,500 % fällig am 01.10.2047		15		2	0,00
Nykredit Realkredit A/S					
0,500 % fällig am 01.10.2053		13		1	0,00
1,000 % fällig am 01.10.2050		0		0	0,00
1,000 % fällig am 01.10.2053		24		2	0,00
1,500 % fällig am 01.10.2050		0		0	0,00
1,500 % fällig am 01.10.2053		13.724		1.450	0,06
2,000 % fällig am 01.10.2053		49.231		5.625	0,22
2,500 % fällig am 01.10.2047		3		0	0,00
3,000 % fällig am 01.10.2053		11.849		1.526	0,06
3,500 % fällig am 01.10.2053		56.276		7.534	0,30
5,000 % fällig am 01.10.2053		4.374		631	0,03
Realkredit Danmark A/S					
1,000 % fällig am 01.10.2050	DKK	4.926	$	519	0,02
1,000 % fällig am 01.10.2053		48.829		4.879	0,19
1,500 % fällig am 01.10.2050		51.006		5.470	0,22
1,500 % fällig am 01.10.2053		109.225		11.486	0,46
2,500 % fällig am 01.04.2047		8		1	0,00
				56.445	2,25
STAATSEMISSIONEN					
Denmark Government International Bond					
0,100 % fällig am 15.11.2023 (b)		109.791		16.107	0,64
Summe Dänemark				72.552	2,89
FRANKREICH					
STAATSEMISSIONEN					
France Government International Bond					
0,100 % fällig am 01.03.2025 (b)	€	33.701		36.107	1,44
0,100 % fällig am 01.03.2026 (b)		33.397		35.710	1,42
0,100 % fällig am 01.03.2028 (b)		39.880		42.717	1,70
0,100 % fällig am 01.03.2029 (b)		8.255		8.767	0,35
0,100 % fällig am 01.03.2032 (b)		3.024		3.224	0,13
0,100 % fällig am 25.07.2036 (b)		14.739		15.123	0,60
0,100 % fällig am 25.07.2038 (b)		746		759	0,03
0,550 % fällig am 01.03.2039 (b)		9.354		10.182	0,41
0,700 % fällig am 25.07.2030 (b)		28.660		31.858	1,27
1,800 % fällig am 25.07.2040 (b)		19.365		25.154	1,00
1,850 % fällig am 25.07.2027 (b)		13.884		15.921	0,63
Summe Frankreich				225.522	8,98
DEUTSCHLAND					
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL					
Landwirtschaftliche Rentenbank					
0,875 % fällig am 15.12.2026	£	7.600		8.215	0,33
STAATSEMISSIONEN					
Bundesrepublik Deutschland					
0,100 % fällig am 15.04.2046 (b)	€	13.564		15.380	0,61
Summe Deutschland				23.595	0,94
IRLAND					
FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE					
Adagio CLO DAC					
3,897 % fällig am 15.10.2031		1.700		1.819	0,07
3,965 % fällig am 10.10.2031		5.800		6.209	0,25
4,541 % fällig am 20.07.2036		11.600		12.656	0,50
Ares European CLO					
3,837 % fällig am 15.10.2030		7.353		7.873	0,31
Ares European CLO DAC					
3,957 % fällig am 15.10.2031		2.200		2.359	0,09
4,050 % fällig am 20.04.2032		600		642	0,03
Armada Euro CLO DAC					
3,897 % fällig am 15.07.2031		4.398		4.694	0,19
4,083 % fällig am 15.11.2031		5.510		5.888	0,23
Avoca CLO DAC					
3,885 % fällig am 12.01.2031		5.483		5.875	0,23
Bain Capital Euro CLO DAC					
3,980 % fällig am 20.04.2032		3.652		3.922	0,16
Black Diamond CLO DAC					
4,303 % fällig am 15.05.2032		7.400		7.899	0,31
Blackrock European CLO DAC					
4,426 % fällig am 15.12.2032		1.900		2.019	0,08
BNPP AM Euro CLO DAC					
4,031 % fällig am 22.07.2032		3.150		3.358	0,13
Bosphorus CLO DAC					
4,346 % fällig am 15.12.2030		2.484		2.669	0,11
Cairn CLO DAC					
3,842 % fällig am 30.04.2031		3.450		3.688	0,15
3,957 % fällig am 15.10.2031		4.500		4.812	0,19
4,212 % fällig am 20.10.2028		115		125	0,01
Carlyle Euro CLO DAC					
3,877 % fällig am 15.01.2031		4.082		4.359	0,17
3,953 % fällig am 15.08.2030		2.898		3.091	0,12
4,213 % fällig am 15.08.2032		5.400		5.759	0,23
Carlyle Global Market Strategies Euro CLO DAC					
3,927 % fällig am 15.07.2030		944		1.015	0,04
Contego CLO DAC					
3,851 % fällig am 23.01.2030	€	1.097	$	1.173	0,05
CVC Cordatus Loan Fund DAC					
4,008 % fällig am 27.01.2031		988		1.059	0,04
4,156 % fällig am 15.09.2031		2.799		2.989	0,12
Dryden Euro CLO DAC					
3,837 % fällig am 15.04.2033		4.200		4.482	0,18
4,183 % fällig am 15.05.2034		2.500		2.669	0,11
Euro-Galaxy CLO DAC					
3,831 % fällig am 24.04.2034		5.600		5.950	0,24
Harvest CLO DAC					
1,040 % fällig am 15.07.2031		1.000		995	0,04
3,880 % fällig am 20.10.2031		2.200		2.351	0,09
3,937 % fällig am 15.07.2031		7.400		7.879	0,31
4,027 % fällig am 15.01.2032		3.700		3.950	0,16
Jubilee CLO DAC					
3,777 % fällig am 15.04.2030		600		639	0,03
3,827 % fällig am 15.04.2031		1.700		1.810	0,07
4,326 % fällig am 15.12.2029		267		288	0,01
Laurelin DAC					
3,920 % fällig am 20.10.2031		3.800		4.071	0,16
Madison Park Euro Funding DAC					
3,977 % fällig am 15.07.2032		7.300		7.768	0,31
Man GLG Euro CLO DAC					
3,857 % fällig am 15.10.2030		2.638		2.826	0,11
4,047 % fällig am 15.01.2030		396		426	0,02
Oak Hill European Credit Partners DAC					
3,940 % fällig am 20.10.2031		1.900		2.019	0,08
OCP Euro CLO DAC					
4,091 % fällig am 22.09.2034		7.300		7.757	0,31
Palmer Square European Loan Funding DAC					
3,897 % fällig am 15.10.2031		4.034		4.314	0,17
3,907 % fällig am 15.07.2031		2.188		2.331	0,09
Purple Finance CLO DAC					
4,061 % fällig am 25.01.2031		1.081		1.168	0,05
Segovia European CLO DAC					
3,945 % fällig am 18.01.2031		881		944	0,04
4,080 % fällig am 20.07.2032		6.400		6.803	0,27
Tikehau CLO DAC					
4,144 % fällig am 04.08.2034		3.500		3.731	0,15
Toro European CLO DAC					
4,133 % fällig am 15.02.2034		10.300		10.937	0,44
				182.060	7,25
NON-AGENCY-MBS					
European Loan Conduit DAC					
4,358 % fällig am 17.02.2030		2.389		2.552	0,10
Glenbeigh Issuer DAC					
4,350 % fällig am 24.06.2050		12.205		13.253	0,53
Primrose Residential DAC					
4,189 % fällig am 24.03.2061		7.223		7.826	0,31
Shamrock Residential DAC					
4,289 % fällig am 24.12.2059		4.514		4.877	0,19
4,689 % fällig am 24.02.2071		6.844		7.424	0,30
				35.932	1,43
Summe Irland				217.992	8,68
ITALIEN					
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL					
UniCredit SpA					
3,375 % fällig am 31.01.2027		7.000		7.536	0,30
STAATSEMISSIONEN					
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro					
0,400 % fällig am 15.05.2030 (b)		26.207		26.154	1,04
1,250 % fällig am 15.09.2032 (b)		9.302		9.764	0,39
1,300 % fällig am 15.05.2028 (b)		58.612		62.740	2,50
1,400 % fällig am 26.05.2025 (b)		70.272		75.914	3,02
2,400 % fällig am 15.05.2039 (b)		40.342		46.185	1,84
				220.757	8,79
Summe Italien				228.293	9,09

BESCHREIBUNG		PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
JAPAN				
STAATSEMISSIONEN				
Japan Government International Bond				
0,005 % fällig am 10.03.2031 (b)	¥	962.016	$ 7.139	0,29
0,100 % fällig am 10.03.2025 (b)		363.460	2.596	0,10
0,100 % fällig am 10.03.2026 (b)		3.537.688	25.639	1,02
0,100 % fällig am 10.03.2028 (b)		3.367.695	24.559	0,98
0,100 % fällig am 10.03.2029 (b)		5.928.919	43.420	1,73
Summe Japan			103.353	4,12
NIEDERLANDE				
NON-AGENCY-MBS				
Eurosail BV				
4,677 % fällig am 17.10.2040	€	923	1.007	0,04
STAATSEMISSIONEN				
BNG Bank NV				
0,500 % fällig am 21.12.2026	£	7.700	8.201	0,33
Nederlandse Waterschapsbank NV				
0,875 % fällig am 30.09.2026		7.500	8.196	0,32
			16.397	0,65
Summe Niederlande			17.404	0,69
NEUSEELAND				
STAATSEMISSIONEN				
New Zealand Government International Bond				
2,000 % fällig am 20.09.2025	NZD	68.806	42.096	1,68
3,000 % fällig am 20.09.2030		53	34	0,00
Summe Neuseeland			42.130	1,68
PERU				
STAATSEMISSIONEN				
Peru Government International Bond				
5,940 % fällig am 12.02.2029	PEN	1.200	325	0,01
SLOWENIEN				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Nova Ljubljanska Banka d.d.				
3,400 % fällig am 05.02.2030	€	1.100	1.020	0,04
SPANIEN				
FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE				
BBVA Consumer Auto				
0,270 % fällig am 20.07.2031		578	615	0,02
STAATSEMISSIONEN				
Spain Government International Bond				
0,000 % fällig am 31.01.2028 (a)		9.600	9.049	0,36
0,500 % fällig am 31.10.2031		200	174	0,01
0,700 % fällig am 30.11.2033 (b)		17.689	18.479	0,74
0,850 % fällig am 30.07.2037		400	305	0,01
1,000 % fällig am 30.11.2030 (b)		2.765	3.010	0,12
1,450 % fällig am 31.10.2027		13.400	13.568	0,54
3,150 % fällig am 30.04.2033		228	244	0,01
3,550 % fällig am 31.10.2033		160	176	0,01
3,900 % fällig am 30.07.2039		500	558	0,02
			45.563	1,82
Summe Spanien			46.178	1,84
SCHWEDEN				
STAATSEMISSIONEN				
Sweden Government International Bond				
0,125 % fällig am 01.06.2026	SEK	115.086	10.352	0,41
0,125 % fällig am 01.12.2027		16.719	1.496	0,06
0,125 % fällig am 01.06.2032		57.120	4.987	0,20
1,000 % fällig am 01.06.2025		128.411	11.813	0,47
Summe Schweden			28.648	1,14

BESCHREIBUNG		PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
SCHWEIZ				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
UBS Group AG				
2,125 % fällig am 13.10.2026	€	900	$ 915	0,04
2,875 % fällig am 02.04.2032		700	667	0,03
4,177 % fällig am 16.01.2026		300	322	0,01
6,373 % fällig am 15.07.2026	$	750	745	0,03
7,750 % fällig am 01.03.2029	€	1.000	1.210	0,05
Summe Schweiz			3.859	0,16
GROSSBRITANNIEN				
NON-AGENCY-MBS				
Alba PLC				
5,191 % fällig am 17.03.2039	£	1.940	2.372	0,09
Atlas Funding PLC				
5,432 % fällig am 25.07.2058		4.670	5.934	0,24
Canada Square Funding PLC				
5,316 % fällig am 17.01.2059		8.889	11.237	0,45
Canterbury Finance PLC				
5,377 % fällig am 16.05.2058		1.083	1.375	0,06
Eurosail PLC				
3,619 % fällig am 13.03.2045	€	1.462	1.576	0,06
3,736 % fällig am 10.06.2044		1.541	1.667	0,07
3,736 % fällig am 10.09.2044		1.965	2.119	0,08
5,140 % fällig am 13.03.2045	£	2.035	2.557	0,10
Great Hall Mortgages PLC				
5,152 % fällig am 18.03.2039		24	31	0,00
5,172 % fällig am 18.06.2038		17	22	0,00
London Wall Mortgage Capital PLC				
5,502 % fällig am 15.05.2052		2.294	2.894	0,12
Polaris PLC				
5,631 % fällig am 23.12.2058		4.606	5.830	0,23
5,640 % fällig am 23.10.2059		10.553	13.325	0,53
Precise Mortgage Funding PLC				
6,065 % fällig am 12.12.2055		3.293	4.201	0,17
Rochester Financing PLC				
5,602 % fällig am 18.12.2044		6.689	8.403	0,34
Stratton BTL Mortgage Funding PLC				
5,221 % fällig am 20.01.2054		4.130	5.224	0,21
Stratton Mortgage Funding PLC				
5,765 % fällig am 12.03.2052		1.634	2.070	0,08
Towd Point Mortgage Funding PLC				
5,635 % fällig am 20.10.2051		2.782	3.542	0,14
5,841 % fällig am 20.07.2045		2.233	2.808	0,11
Tower Bridge Funding PLC				
5,527 % fällig am 20.11.2063		2.157	2.728	0,11
5,629 % fällig am 20.12.2063		3.212	4.065	0,16
Twin Bridges PLC				
6,115 % fällig am 12.12.2054		5.179	6.599	0,26
			90.579	3,61
STAATSEMISSIONEN				
United Kingdom Gilt				
0,125 % fällig am 10.08.2028 (b)		36.163	44.223	1,76
0,125 % fällig am 10.08.2031 (b)		19.798	24.473	0,98
0,125 % fällig am 22.03.2039 (b)		8.037	9.116	0,36
0,125 % fällig am 10.08.2041 (b)		10.801	12.006	0,48
0,125 % fällig am 22.03.2044 (b)		13.884	14.833	0,59
0,125 % fällig am 22.03.2046 (b)		7.083	7.393	0,29
0,125 % fällig am 10.08.2048 (b)		5.600	5.765	0,23
0,125 % fällig am 22.03.2051 (b)		17.724	17.948	0,72
0,125 % fällig am 22.11.2056 (b)		7.806	7.828	0,31
0,125 % fällig am 22.03.2058 (b)		14.358	14.367	0,57
0,125 % fällig am 22.11.2065 (b)		9.799	9.909	0,39
0,125 % fällig am 22.03.2068 (b)		14.624	14.798	0,59
0,125 % fällig am 22.03.2073 (b)		2.659	2.867	0,11
0,250 % fällig am 22.03.2052 (b)		19.715	20.759	0,83
0,375 % fällig am 22.03.2062 (b)		17.886	19.719	0,79
0,500 % fällig am 22.03.2050 (b)		11.664	13.178	0,53
0,500 % fällig am 22.10.2061		6.200	2.502	0,10
0,625 % fällig am 22.03.2040 (b)		21.787	26.671	1,06
0,625 % fällig am 22.11.2042 (b)		14.818	17.914	0,71
0,625 % fällig am 22.03.2045 (b)		16.791	19.727	0,79
0,625 % fällig am 22.10.2050		2.400	1.240	0,05
0,750 % fällig am 22.03.2034 (b)		29.844	38.352	1,53
0,750 % fällig am 22.11.2047 (b)		11.621	13.972	0,56
1,125 % fällig am 22.11.2037 (b)		21.925	29.146	1,16

BESCHREIBUNG		PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
1,250 % fällig am 22.11.2027 (b)	£	27.069	$ 34.764	1,39
1,250 % fällig am 22.11.2032 (b)		39.839	54.038	2,15
1,250 % fällig am 22.10.2041		400	306	0,01
1,250 % fällig am 22.11.2055 (b)		15.668	21.936	0,87
1,500 % fällig am 22.07.2047		3.900	2.805	0,11
2,000 % fällig am 26.01.2035		3.509	5.191	0,21
2,500 % fällig am 17.07.2024		13.574	17.607	0,70
4,125 % fällig am 22.07.2030		13.242	21.189	0,84
			546.542	21,77
Summe Großbritannien			637.121	25,38
USA				
FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE				
Accredited Mortgage Loan Trust				
5,410 % fällig am 25.09.2036	$	1.322	1.300	0,05
ACE Securities Corp. Home Equity Loan Trust				
6,200 % fällig am 25.12.2033		1.164	1.135	0,05
Ameriquest Mortgage Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates				
6,110 % fällig am 25.10.2035		1.678	1.503	0,06
Amresco Residential Securities Corp. Mortgage Loan Trust				
6,090 % fällig am 25.06.2029		8	8	0,00
Asset-Backed Funding Certificates Trust				
5,290 % fällig am 25.10.2036		6.455	5.894	0,23
5,750 % fällig am 25.10.2034		260	261	0,01
Asset-Backed Securities Corp. Home Equity Loan Trust				
6,543 % fällig am 15.04.2033		167	164	0,01
Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust				
4,807 % fällig am 25.05.2035		221	219	0,01
Carrington Mortgage Loan Trust				
5,400 % fällig am 25.04.2036		12.546	11.023	0,44
CIT Mortgage Loan Trust				
6,500 % fällig am 25.10.2037		61	61	0,00
Citigroup Mortgage Loan Trust				
5,440 % fällig am 25.09.2036		434	410	0,02
Citigroup Mortgage Loan Trust Asset-Backed Pass-Through Certificates				
6,095 % fällig am 25.10.2034		823	779	0,03
Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.				
5,840 % fällig am 25.10.2035 ^		3.100	2.773	0,11
Countrywide Asset-Backed Certificates Trust				
6,110 % fällig am 25.02.2036		7.529	7.342	0,29
Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp.				
4,599 % fällig am 25.01.2032		1	1	0,00
Ellington Loan Acquisition Trust				
6,250 % fällig am 25.05.2037		793	759	0,03
Encore Credit Receivables Trust				
6,050 % fällig am 25.01.2036		1.400	1.318	0,05
First Franklin Mortgage Loan Trust				
5,460 % fällig am 25.07.2036		898	848	0,03
6,020 % fällig am 25.09.2035		1.218	1.199	0,05
Home Equity Asset Trust				
6,005 % fällig am 25.08.2034		55	53	0,00
Home Equity Mortgage Loan Asset-Backed Trust				
5,790 % fällig am 25.03.2036		1.786	1.756	0,07
HSI Asset Securitization Corp. Trust				
5,470 % fällig am 25.05.2037		219	218	0,01
Lehman XS Trust				
7,450 % fällig am 25.12.2037		1.730	1.753	0,07
Massachusetts Educational Financing Authority				
6,205 % fällig am 25.04.2038		36	36	0,00
Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust				
5,810 % fällig am 25.01.2035		1.537	1.488	0,06
New Century Home Equity Loan Trust				
5,870 % fällig am 25.10.2035		732	699	0,03
5,915 % fällig am 25.02.2035		1.963	1.794	0,07
Nomura Home Equity Loan, Inc. Home Equity Loan Trust				
5,585 % fällig am 25.03.2036		649	637	0,03
Park Place Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates				
5,945 % fällig am 25.07.2035		47	46	0,00
Saxon Asset Securities Trust				
1,942 % fällig am 25.05.2035		3.444	3.166	0,13
5,460 % fällig am 25.09.2037		819	773	0,03
			49.416	1,97

BESCHREIBUNG		PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Eversource Energy				
2,900 % fällig am 01.10.2024	$	100	$ 96	0,00
Lehman Brothers Holdings, Inc.				
0,000 % fällig am 05.03.2010 ^	€	950	6	0,00
0,000 % fällig am 05.04.2011 ^		10	0	0,00
			102	0,00
NON-AGENCY-MBS				
Banc of America Funding Trust				
3,826 % fällig am 20.01.2047	$	1.033	882	0,04
Bear Stearns ALT-A Trust				
4,202 % fällig am 25.09.2035 ^		58	36	0,00
Citigroup Mortgage Loan Trust				
3,974 % fällig am 25.09.2037 ^		213	187	0,01
Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.				
6,430 % fällig am 25.09.2035		2	2	0,00
Countrywide Alternative Loan Trust				
6,000 % fällig am 25.04.2037		830	708	0,03
Credit Suisse Mortgage Capital Certificates				
3,519 % fällig am 30.11.2037		1.172	1.076	0,04
Downey Savings & Loan Association Mortgage Loan Trust				
5,737 % fällig am 19.10.2045		2.544	2.176	0,09
GreenPoint Mortgage Funding Trust				
5,590 % fällig am 25.06.2045		75	70	0,00
GSR Mortgage Loan Trust				
4,070 % fällig am 25.09.2035		45	43	0,00
Impac CMB Trust				
5,790 % fällig am 25.03.2035		1.085	994	0,04
JPMorgan Mortgage Trust				
4,319 % fällig am 25.07.2035		168	159	0,01
Mellon Residential Funding Corp. Mortgage Pass-Through Trust				
5,632 % fällig am 20.10.2029		10	10	0,00
6,053 % fällig am 15.08.2032		117	109	0,00
Merrill Lynch Mortgage Investors Trust				
5,840 % fällig am 25.08.2036		3.768	3.544	0,14
OBX Trust				
5,800 % fällig am 25.06.2057		168	160	0,01
Opteum Mortgage Acceptance Corp. Asset-Backed Pass-Through Certificates				
6,950 % fällig am 25.04.2035		820	788	0,03
Sequoia Mortgage Trust				
5,846 % fällig am 19.10.2026		4	4	0,00
Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust				
4,263 % fällig am 25.08.2047		1.661	1.559	0,06
4,984 % fällig am 25.09.2034		257	244	0,01

BESCHREIBUNG		PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
Structured Asset Securities Corp.				
5,500 % fällig am 25.03.2035		198	169	0,01
WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust				
5,690 % fällig am 25.12.2045		20	20	0,00
5,710 % fällig am 25.11.2045		664	608	0,02
			13.548	0,54
US-REGIERUNGSBEHÖRDEN				
Fannie Mae				
4,633 % fällig am 01.12.2030	$	1	$ 1	0,00
4,944 % fällig am 01.09.2044		20	19	0,00
Freddie Mac				
3,759 % fällig am 01.09.2036		19	19	0,00
3,928 % fällig am 01.10.2036		24	24	0,00
5,176 % fällig am 25.10.2044		212	195	0,01
5,280 % fällig am 25.08.2031		4	4	0,00
5,290 % fällig am 25.09.2031		7	6	0,00
5,793 % fällig am 15.12.2037		129	127	0,01
6,049 % fällig am 01.07.2036		51	51	0,00
Ginnie Mae				
2,875 % fällig am 20.04.2030		2	3	0,00
3,000 % fällig am 20.05.2030		2	2	0,00
3,375 % fällig am 20.05.2030		24	24	0,00
3,858 % fällig am 20.08.2068		1.793	1.746	0,07
Uniform Mortgage-Backed Security, TBA				
4,000 % fällig am 01.08.2053		57.400	53.918	2,15
4,500 % fällig am 01.08.2053		100.400	96.580	3,84
			152.719	6,08
US-SCHATZOBLIGATIONEN				
U.S. Treasury Inflation Protected Securities (b)				
0,125 % fällig am 15.07.2024		28.103	27.263	1,09
0,125 % fällig am 15.10.2024		31.801	30.677	1,22
0,125 % fällig am 15.04.2025 (d)		97.698	92.954	3,70
0,125 % fällig am 15.10.2025		25.016	23.721	0,94
0,125 % fällig am 15.04.2026 (d)		55.851	52.382	2,09
0,125 % fällig am 15.07.2026		37.556	35.286	1,41
0,125 % fällig am 15.10.2026 (d)		43.956	41.102	1,64
0,125 % fällig am 15.04.2027		19.229	17.803	0,71
0,125 % fällig am 15.01.2030 (d)		75.921	68.133	2,71
0,125 % fällig am 15.07.2030		26.026	23.351	0,93
0,125 % fällig am 15.01.2031		8.739	7.770	0,31
0,125 % fällig am 15.07.2031 (d)		187.959	166.759	6,64
0,125 % fällig am 15.01.2032		30.309	26.697	1,06
0,125 % fällig am 15.02.2051		14.458	9.660	0,38
0,125 % fällig am 15.02.2052		3.705	2.461	0,10
0,250 % fällig am 15.01.2025		16.007	15.347	0,61
0,250 % fällig am 15.07.2029 (d)		73.214	66.881	2,66

BESCHREIBUNG		PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
0,250 % fällig am 15.02.2050		18.404	12.889	0,51
0,375 % fällig am 15.07.2025		32.103	30.727	1,22
0,375 % fällig am 15.01.2027		24.811	23.286	0,93
0,375 % fällig am 15.07.2027		16.020	15.022	0,60
0,500 % fällig am 15.04.2024		7.817	7.628	0,30
0,500 % fällig am 15.01.2028 (d)		110.334	103.236	4,11
0,625 % fällig am 15.01.2024		22.714	22.330	0,89
0,625 % fällig am 15.01.2026		11.284	10.762	0,43
0,625 % fällig am 15.07.2032 (d)		34.867	32.066	1,28
0,625 % fällig am 15.02.2043		14.222	11.678	0,47
0,750 % fällig am 15.07.2028		39.827	37.753	1,50
0,750 % fällig am 15.02.2042		20.269	17.239	0,69
0,750 % fällig am 15.02.2045		25.877	21.408	0,85
0,875 % fällig am 15.01.2029		1.946	1.843	0,07
0,875 % fällig am 15.02.2047		20.230	16.992	0,68
1,000 % fällig am 15.02.2046		29.429	25.557	1,02
1,000 % fällig am 15.02.2048		18.949	16.318	0,65
1,000 % fällig am 15.02.2049	$	16.513	$ 14.218	0,57
1,125 % fällig am 15.01.2033 (d)		26.678	25.577	1,02
1,375 % fällig am 15.02.2044 (d)		33.538	31.622	1,26
1,500 % fällig am 15.02.2053		8.163	7.933	0,32
1,625 % fällig am 15.10.2027 (d)		74.848	73.771	2,94
2,000 % fällig am 15.01.2026		17.379	17.150	0,68
2,125 % fällig am 15.02.2040		15.493	16.636	0,66
2,125 % fällig am 15.02.2041 (d)		39.294	42.199	1,68
2,375 % fällig am 15.01.2025		27.017	26.738	1,07
3,625 % fällig am 15.04.2028 (d)		55.098	59.159	2,36
			1.429.984	56,96
Summe USA			1.645.769	65,55
KURZFRISTIGE INSTRUMENTE				
COMMERCIAL PAPER				
AT+T, Inc.				
5,700 % fällig am 19.03.2024		6.800	6.510	0,26
Summe kurzfristige Instrumente			6.510	0,26
Summe Übertragbare Wertpapiere			**$ 3.401.577**	**135,49**
		AKTIEN		
INVESTMENTFONDS				
ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN				
PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (c)		1.020.375	10.161	0,40
Summe Investmentfonds			**$10.161**	**0,40**

PENSIONSGESCHÄFTE

Kontrahent	Kredit-zins	Abrechnungs-datum	Fälligkeits-datum	Kapital-betrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensions-geschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensions-geschäft[1]	% des Nettovermögens
FICC	2,400 %	30.06.2023	03.07.2023	$ 2.272	U.S. Treasury Notes 4,625 % fällig am 30.06.2025	$ (2.317)	$ 2.272	$ 2.272	0,09
Summe Pensionsgeschäfte						**$ (2.317)**	**$ 2.272**	**$ 2.272**	**0,09**

[1] Umfasst aufgelaufene Zinsen.

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

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

FUTURES

Beschreibung	Art	Ablauf-monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Australia Government 3-Year Note September Futures	Short	09.2023	205	$ 84	0,00
Australia Government 10-Year Bond September Futures	Long	09.2023	43	(18)	0,00
Euro-Bobl September Futures	Short	09.2023	811	1.494	0,06
Euro-BTP Italy Government Bond September Futures	Short	09.2023	180	(198)	(0,01)
Euro-BTP Italy Government Bond September Futures	Short	09.2023	36	36	0,00
Euro-Bund 10-Year Bond September Futures	Long	09.2023	203	(280)	(0,01)
Euro-Buxl 30-Year Bond September Futures	Long	09.2023	102	101	0,01
Euro-OAT France Government 10-Year Bond September Futures	Long	09.2023	261	(27)	0,00
Euro-Schatz September Futures	Short	09.2023	3.063	2.718	0,11
Japan Government 10-Year Bond September Futures	Short	09.2023	48	(174)	(0,01)
U.S. Treasury 2-Year Note September Futures	Short	09.2023	129	285	0,01
U.S. Treasury 5-Year Note September Futures	Short	09.2023	865	1.029	0,04
U.S. Treasury 10-Year Note September Futures	Short	09.2023	1.481	2.891	0,12
U.S. Treasury 10-Year Ultra September Futures	Short	09.2023	442	553	0,02
U.S. Treasury 30-Year Bond September Futures	Short	09.2023	42	1	0,00
U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond September Futures	Short	09.2023	147	(290)	(0,01)
United Kingdom Long Gilt September Futures	Short	09.2023	339	44	0,00
				$ 8.249	0,33

VERKAUFSOPTIONEN

OPTIONEN AUF BÖRSENGEHANDELTE TERMINKONTRAKTE

Beschreibung	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Anzahl der Kontrakte	Aufgeld	Markt-wert	% des Nettovermögens
Put - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note August Futures	$ 113,000	21.07.2023	388	$ (274)	$ (432)	(0,02)
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate					**$ 7.817**	**0,31**

ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)

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

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMMISSIONEN - SCHUTZVERKAUF[1]

Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag[2]	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
General Electric Co.	1,000 %	20.12.2023	$ 800	$ 47	0,00

ZINSSWAPS

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Zahlung[3]	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	3,250 %	20.09.2053	£ 4.800	$ (434)	(0,02)
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,000	16.06.2029	¥ 10.717.000	(771)	(0,03)
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,435	20.06.2029	3.683.000	(181)	(0,01)
Erhalt[3]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,840	21.11.2028	$ 19.700	1.880	0,07
Zahlung[3]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,880	25.01.2052	13.400	(3.758)	(0,15)
Zahlung[3]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,888	21.11.2053	7.400	(2.090)	(0,08)
Erhalt[3]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,865	13.02.2054	32.200	692	0,03
Zahlung[3]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,085	13.02.2034	82.600	(1.486)	(0,06)
Erhalt[3]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,250	20.12.2053	9.000	(13)	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,400	23.02.2033	5.300	(78)	0,00
Zahlung[3]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,500	20.12.2033	16.700	(132)	(0,01)
Erhalt[3]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	4,250	20.12.2025	134.900	809	0,03
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,880	25.07.2023	13.400	(53)	0,00
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	0,550	10.08.2024	€ 6.500	(291)	(0,01)
Erhalt[3]	6-Month EUR-EURIBOR	2,500	20.09.2053	68.400	(663)	(0,03)
Zahlung[3]	6-Month EUR-EURIBOR	3,000	20.09.2028	47.600	113	0,00
Zahlung[3]	6-Month EUR-EURIBOR	3,000	20.09.2033	119.200	121	0,00
Erhalt[3]	6-Month EUR-EURIBOR	3,500	20.09.2025	150.500	(80)	0,00
Erhalt	CPTFEMU	1,710	15.03.2033	5.900	1.675	0,07
Erhalt	CPTFEMU	2,359	15.08.2030	25.700	1.119	0,04
Erhalt	CPTFEMU	2,470	15.07.2032	12.900	625	0,02
Zahlung	CPTFEMU	2,570	15.06.2032	1.300	1	0,00
Erhalt	CPTFEMU	2,600	15.05.2032	20.300	950	0,04
Zahlung	CPTFEMU	2,680	15.04.2053	6.400	(94)	0,00
Zahlung	CPTFEMU	2,700	15.04.2053	8.500	0	0,00
Erhalt	CPTFEMU	2,720	15.06.2032	63.300	1.539	0,06
Erhalt	CPTFEMU	2,975	15.08.2027	17.800	246	0,01
Zahlung	CPTFEMU	3,520	15.09.2024	23.800	(296)	(0,01)
Zahlung	CPTFEMU	3,720	15.09.2024	6.400	(44)	0,00

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Zahlung	CPTFEMU	3,850 %	15.09.2024	€ 27.600	$ (172)	(0,01)
Zahlung	CPURNSA	1,760	04.11.2029	$ 23.300	(3.512)	(0,14)
Zahlung	CPURNSA	1,883	20.11.2029	300	(42)	0,00
Zahlung	CPURNSA	1,954	03.06.2029	6.200	(824)	(0,03)
Zahlung	CPURNSA	1,998	25.07.2029	1.800	(228)	(0,01)
Erhalt	CPURNSA	2,311	24.02.2031	6.500	699	0,03
Erhalt	CPURNSA	2,314	26.02.2026	14.400	1.421	0,06
Zahlung	CPURNSA	2,364	10.05.2028	800	(69)	0,00
Zahlung	CPURNSA	2,370	06.06.2028	12.900	(1.118)	(0,05)
Zahlung	CPURNSA	2,379	09.07.2028	700	(59)	0,00
Erhalt	CPURNSA	2,573	26.08.2028	2.200	136	0,01
Erhalt	CPURNSA	2,645	10.09.2028	3.600	195	0,01
Erhalt	CPURNSA	2,690	01.06.2026	2.300	172	0,01
Erhalt	CPURNSA	2,703	25.05.2026	8.980	672	0,03
Erhalt	CPURNSA	2,768	13.05.2026	13.900	1.014	0,04
Erhalt	CPURNSA	2,813	14.05.2026	20.100	1.420	0,06
Zahlung	UKRPI	3,835	15.10.2032	£ 22.800	(1.968)	(0,08)
Erhalt	UKRPI	4,140	15.10.2031	14.200	1.520	0,06
Zahlung	UKRPI	4,143	15.10.2032	22.800	(1.765)	(0,07)
Erhalt	UKRPI	4,250	15.11.2031	17.860	1.962	0,08
Erhalt	UKRPI	4,300	15.01.2032	6.000	403	0,01
Erhalt	UKRPI	4,615	15.02.2027	12.300	772	0,03
Erhalt	UKRPI	5,200	15.06.2024	5.500	359	0,01
Erhalt	UKRPI	5,330	15.06.2024	11.900	737	0,03
Erhalt	UKRPI	6,290	15.03.2024	5.500	461	0,02
Erhalt	UKRPI	6,440	15.05.2024	2.200	152	0,01
Zahlung	UKRPI	6,500	15.03.2024	26.700	(2.088)	(0,08)
Erhalt	UKRPI	6,600	15.05.2024	5.400	350	0,01
					$ (94)	0,00
Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate					**$ (47)**	**0,00**

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

(2) Der maximal mögliche Betrag, den der Fonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

(3) Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft.

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

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

OPTIONSKAUF

ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag[1]	Kosten	Markt-wert	% des Nettovermögens
DUB	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,237 %	17.11.2023	27.000	$ 1.676	$ 5.924	0,24

VERKAUFSOPTIONEN

INFLATION-CAPPED OPTIONS

Kontrahent	Beschreibung	Anfänglicher Index	Variabler Zinssatz	Verfalls-datum	Nenn-betrag[1]	Aufgeld	Markt-wert	% des Nettovermögens
GLM	Cap - OTC CPALEMU	$ 100,151	Maximal [(Index Final/Index Initial - 1) - 3,000 %] oder 0	22.06.2035	7.800	$ (356)	$ (439)	(0,02)
JPM	Cap - OTC CPURNSA	233,916	Maximal [(Index Final/Index Initial - 1) - 4,000 %] oder 0	22.04.2024	37.600	(273)	0	0,00
	Cap - OTC CPURNSA	234,781	Maximal [(Index Final/Index Initial - 1) - 4,000 %] oder 0	16.05.2024	3.100	(22)	0	0,00
						$ (651)	$ (439)	(0,02)

ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag[1]	Aufgeld	Markt-wert	% des Nettovermögens
BPS	Call - OTC 2-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,750 %	12.09.2023	61.100	$ (174)	$ (70)	0,00
DUB	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,340	17.11.2023	133.200	(1.678)	(9.825)	(0,39)
FAR	Call - OTC 2-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	4,420	21.09.2023	138.300	(787)	(591)	(0,02)
JPM	Call - OTC 2-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,750	12.09.2023	85.400	(239)	(99)	(0,01)
							$ (2.878)	$ (10.585)	(0,42)

(1) Der Nennbetrag stellt die Anzahl der Kontrakte dar.

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES - SCHUTZVERKAUF[1]

Kontrahent	Index/Tranchen	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag[2]	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Markt-wert	% des Nettovermögens
GST	CMBX.NA.AAA.8 Index	0,500 %	17.10.2057	$ 12.200	$ (713)	$ 711	$ (2)	0,00
SAL	CMBX.NA.AAA.12 Index	0,500	17.08.2061	2.500	(5)	(23)	(28)	0,00
					$ (718)	$ 688	$ (30)	0,00

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

(2) Der maximal mögliche Betrag, den der Fonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung		Zu erhaltende Währung		Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
AZD	07.2023	AUD	940	$	615	$ 0	$ (11)	$ (11)	0,00
	07.2023	$	3.434	AUD	5.175	11	0	11	0,00
	08.2023	AUD	5.175	$	3.437	0	(11)	(11)	0,00
BOA	07.2023		8.748		5.707	0	(116)	(116)	(0,01)
	07.2023	CAD	51.867		38.118	0	(1.078)	(1.078)	(0,04)
	07.2023	DKK	130.252		18.809	0	(276)	(276)	(0,01)
	07.2023	€	40.946		44.049	0	(624)	(624)	(0,03)
	07.2023	NZD	17.742		10.764	0	(106)	(106)	(0,01)
	07.2023	$	33.332	DKK	226.631	0	(125)	(125)	(0,01)
	07.2023		5.602	£	4.430	30	0	30	0,00
	08.2023	DKK	226.252	$	33.332	126	0	126	0,01
BPS	07.2023	¥	13.178.675		94.855	3.676	0	3.676	0,15
	07.2023	$	2.450	AUD	3.699	12	0	12	0,00
	07.2023		1.475	€	1.356	5	0	5	0,00
	07.2023		7.091	£	5.561	0	(21)	(21)	0,00
	08.2023	AUD	3.699	$	2.452	0	(12)	(12)	0,00
BRC	07.2023	NZD	418		251	0	(5)	(5)	0,00
CBK	07.2023	AUD	3.267		2.131	0	(43)	(43)	0,00
	07.2023	€	5.417		5.813	0	(97)	(97)	0,00
	07.2023	£	4.190		5.259	0	(68)	(68)	0,00
IND	07.2023	DKK	382.791		55.253	0	(835)	(835)	(0,03)
JPM	07.2023	AUD	7.269		4.752	0	(86)	(86)	0,00
	07.2023	NZD	4.075		2.513	16	0	16	0,00
	07.2023	$	3.021	DKK	20.815	28	0	28	0,00
	07.2023		755.430	€	691.849	0	(622)	(622)	(0,03)
	07.2023		641.676	£	507.494	3.527	0	3.527	0,14
	07.2023		31.382	¥	4.487.945	0	(331)	(331)	(0,01)
	07.2023		42.427	NZD	69.621	226	0	226	0,01
	08.2023	€	691.849	$	756.486	645	0	645	0,02
	08.2023	£	507.494		641.812	0	(3.520)	(3.520)	(0,14)
	08.2023	¥	4.468.874		31.382	332	0	332	0,01
	08.2023	NZD	69.621		42.424	0	(225)	(225)	(0,01)
	09.2023	PEN	8.962		2.434	0	(24)	(24)	0,00
MBC	07.2023	€	9.704		10.499	0	(88)	(88)	0,00
	07.2023	SEK	3.780		351	1	0	1	0,00
	07.2023	$	16.916	€	15.739	262	(7)	255	0,01
	07.2023		37.839	£	30.364	764	0	764	0,03
MYI	07.2023	£	548.131	$	681.252	0	(15.616)	(15.616)	(0,62)
	07.2023	NZD	1.178		713	0	(9)	(9)	0,00
	07.2023	SEK	291.863		27.189	168	0	168	0,01
	07.2023	$	29.630	DKK	202.115	0	(15)	(15)	0,00
	07.2023		1.412	€	1.296	2	0	2	0,00
	07.2023		11.728	£	9.373	189	0	189	0,01
	07.2023		27.554	SEK	297.493	0	(12)	(12)	0,00
	08.2023	DKK	201.778	$	29.630	16	0	16	0,00
	08.2023	SEK	297.124		27.554	12	0	12	0,00
SCX	07.2023	AUD	10.261		6.705	0	(125)	(125)	(0,01)
	07.2023	NZD	46.208		28.055	0	(254)	(254)	(0,01)
	07.2023	SEK	1.389		128	0	0	0	0,00
	07.2023	$	5.046	AUD	7.601	14	0	14	0,00
	08.2023	AUD	7.601	$	5.050	0	(14)	(14)	0,00
SOG	07.2023		6.212		4.064	0	(71)	(71)	0,00
	07.2023	€	652.877		702.325	0	(9.963)	(9.963)	(0,40)
TOR	07.2023	AUD	3.287		2.150	0	(38)	(38)	0,00
	07.2023	$	6.178	AUD	9.354	48	0	48	0,00
	07.2023		39.201	CAD	51.871	27	(29)	(2)	0,00
	07.2023		60.348	¥	8.690.127	0	(223)	(223)	(0,01)
	08.2023	AUD	9.354	$	6.183	0	(48)	(48)	0,00
	08.2023	CAD	51.850		39.201	28	(27)	1	0,00
	08.2023	¥	8.653.272		60.348	225	0	225	0,01
UAG	07.2023	AUD	752		493	0	(8)	(8)	0,00
	07.2023	$	9.954	AUD	14.908	21	(52)	(31)	0,00
	08.2023	AUD	14.908	$	9.962	52	(21)	31	0,00
						$ 10.463	$ (34.856)	$ (24.393)	(0,97)

ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklassen Institutional CHF (Hedged) thesaurierend, Institutional CHF (Hedged) ausschüttend und Investor CHF (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung		Zu erhaltende Währung		Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2023	$	8	CHF	7	$ 0	$ 0	$ 0	0,00
BPS	07.2023	CHF	29.237	$	32.691	11	0	11	0,00
	07.2023	$	44.078	CHF	39.879	497	0	497	0,02
	08.2023		32.691		29.154	0	(11)	(11)	0,00
IND	07.2023	CHF	15.453	$	17.203	0	(69)	(69)	0,00
	08.2023	$	17.203	CHF	15.409	69	0	69	0,00
JPM	07.2023		657		594	7	0	7	0,00
MBC	07.2023	CHF	19	$	21	0	0	0	0,00
	07.2023	$	118	CHF	106	0	0	0	0,00
MYI	07.2023	CHF	1.713	$	1.892	0	(22)	(22)	0,00
RBC	07.2023	$	8	CHF	7	0	0	0	0,00
RYL	07.2023		4		3	0	0	0	0,00
SCX	07.2023		31.135		27.976	136	0	136	0,01
UAG	07.2023	CHF	30.223	$	33.716	0	(67)	(67)	0,00
	07.2023	$	27.989	CHF	25.149	122	0	122	0,00
	08.2023		33.716		30.137	66	0	66	0,00
						$ 908	$ (169)	$ 739	0,03

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklasse Institutional USD (Currency Exposure) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung		Zu erhaltende Währung		Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
AZD	07.2023	AUD	116	$	77	$ 0	$ 0	$ 0	0,00
	07.2023	$	34	AUD	53	1	0	1	0,00
	08.2023		77		116	0	0	0	0,00
BOA	07.2023	DKK	212	$	31	0	0	0	0,00
	07.2023	¥	70		1	0	0	0	0,00
	07.2023	SEK	3.055		283	0	0	0	0,00
	07.2023	$	43	AUD	66	1	0	1	0,00
	07.2023		828	CAD	1.127	23	0	23	0,00
	07.2023		17	DKK	117	0	0	0	0,00
	07.2023		68	NZD	111	1	0	1	0,00
	07.2023		2	SEK	21	0	0	0	0,00
	08.2023		31	DKK	212	0	0	0	0,00
	08.2023		283	SEK	3.051	0	0	0	0,00
BPS	07.2023	AUD	83	$	55	0	0	0	0,00
	07.2023	€	8.688		9.519	41	0	41	0,00
	07.2023	$	0	DKK	0	0	0	0	0,00
	07.2023		1.266	¥	175.905	0	(48)	(48)	(0,01)
	07.2023		2	NZD	3	0	0	0	0,00
	08.2023		55	AUD	83	0	0	0	0,00
	08.2023		9.532	€	8.688	0	(41)	(41)	0,00
CBK	07.2023		144		134	2	0	2	0,00
IND	07.2023		50	DKK	343	1	0	1	0,00
JPM	07.2023	¥	59.880	$	419	4	0	4	0,00
	08.2023	$	419	¥	59.626	0	(4)	(4)	0,00
MBC	07.2023	CAD	68	$	50	0	(1)	(1)	0,00
	07.2023	£	514		640	0	(13)	(13)	0,00
	07.2023	$	10.211	£	8.249	276	0	276	0,02
	07.2023		4	SEK	39	0	0	0	0,00
MYI	07.2023	DKK	189	$	28	0	0	0	0,00
	07.2023	$	4	NZD	7	0	0	0	0,00
	07.2023		279	SEK	2.992	0	(2)	(2)	0,00
	08.2023		28	DKK	189	0	0	0	0,00
SCX	07.2023	AUD	170	$	113	0	0	0	0,00
	07.2023	$	176	NZD	290	2	0	2	0,00
	08.2023		113	AUD	170	0	0	0	0,00
SOG	07.2023		227		347	4	0	4	0,00
	07.2023		9.202	€	8.554	131	0	131	0,01
TOR	07.2023	AUD	209	$	138	0	(1)	(1)	0,00
	07.2023	CAD	750		565	0	(2)	(2)	0,00
	07.2023	£	7.736		9.830	0	(5)	(5)	0,00
	07.2023	NZD	412		251	0	(2)	(2)	0,00
	07.2023	$	120	AUD	184	2	0	2	0,00
	08.2023		138		209	1	0	1	0,00
	08.2023		565	CAD	750	2	0	2	0,00
	08.2023		9.832	£	7.736	5	0	5	0,00
	08.2023		251	NZD	412	1	0	1	0,00
UAG	07.2023	AUD	114	$	75	0	0	0	0,00
	07.2023	$	28	AUD	42	0	0	0	0,00
	08.2023		75		114	0	0	0	0,00
						$ 498	$ (119)	$ 379	0,02

Zum 30. Juni 2023 standen für die Institutional EUR (Hedged) thesaurierend, Institutional EUR (Hedged) ausschüttend, Investor EUR (Hedged) thesaurierend und Class E EUR (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2023	€ 5.432	$ 5.924	$ 8	$ (10)	$ (2)	0,00
	07.2023	$ 401.643	€ 373.724	6.089	0	6.089	0,23
BPS	07.2023	€ 375.124	$ 411.005	1.748	(3)	1.745	0,07
	07.2023	$ 401.431	€ 373.420	5.971	(1)	5.970	0,24
	08.2023	407.371	371.269	0	(1.762)	(1.762)	(0,07)
CBK	07.2023	€ 393.961	$ 427.971	7	(1.846)	(1.839)	(0,07)
	08.2023	$ 395.113	€ 362.910	1.365	0	1.365	0,05
JPM	07.2023	€ 370.713	$ 404.781	334	0	334	0,01
	07.2023	$ 32.087	€ 30.011	655	0	655	0,02
	08.2023	405.347	370.713	0	(346)	(346)	(0,01)
MBC	07.2023	€ 7.537	$ 8.124	5	(104)	(99)	0,00
	07.2023	$ 207	€ 194	4	0	4	0,00
SOG	07.2023	401.628	373.351	5.698	0	5.698	0,23
				$ 21.884	$ (4.072)	$ 17.812	0,70

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklassen Institutional GBP (Hedged) thesaurierend, Institutional GBP (Hedged) ausschüttend and R Class GBP (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2023	£ 705	$ 887	$ 0	$ (9)	$ (9)	0,00
BPS	07.2023	571	706	0	(20)	(20)	0,00
	07.2023	$ 110.483	£ 89.321	3.076	(1)	3.075	0,12
BRC	07.2023	£ 503	$ 630	0	(10)	(10)	0,00
CBK	07.2023	1.149	1.451	0	(10)	(10)	0,00
	07.2023	$ 2.360	£ 1.849	1	(10)	(9)	0,00
JPM	07.2023	£ 89.037	$ 112.579	0	(619)	(619)	(0,02)
	08.2023	$ 112.603	£ 89.037	618	0	618	0,02
MBC	07.2023	111.239	89.852	2.995	(1)	2.994	0,11
MYI	07.2023	£ 81	$ 100	0	(3)	(3)	0,00
	07.2023	$ 110.059	£ 88.553	2.523	0	2.523	0,10
TOR	07.2023	£ 89.242	$ 113.400	0	(58)	(58)	0,00
	08.2023	$ 113.425	£ 89.242	56	0	56	0,00
				$ 9.269	$ (741)	$ 8.528	0,33

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklasse Institutional SGD (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BRC	07.2023	$ 58.438	SGD 79.073	$ 0	$ (10)	$ (10)	0,00
GLM	07.2023	SGD 6.452	$ 4.807	40	0	40	0,00
	07.2023	$ 1.185	SGD 1.597	0	(6)	(6)	0,00
JPM	07.2023	SGD 77.974	$ 57.622	6	0	6	0,00
	07.2023	$ 9.900	SGD 13.399	1	0	1	0,00
	08.2023	57.622	77.899	0	(5)	(5)	0,00
MBC	07.2023	53.127	71.780	0	(88)	(88)	0,00
MYI	07.2023	SGD 75.541	$ 55.906	89	0	89	0,00
	08.2023	$ 55.906	SGD 75.472	0	(84)	(84)	0,00
UAG	07.2023	57.315	77.535	0	(24)	(24)	0,00
				$ 136	$ (217)	$ (81)	0,00

Summe Freiverkehrsfinanzderivate	**$ (2.146)**	**(0,09)**
Summe Anlagen	**$ 3.419.634**	**136,20**
Sonstige Aktiva und Passiva	**$ (908.965)**	**(36,20)**
Nettovermögen	**$ 2.510.669**	**100,00**

ERLÄUTERUNGEN ZUR AUFSTELLUNG DES WERTPAPIERBESTANDS (Angaben in Tausend*):

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

^ **Das Wertpapier ist in Verzug.**

(a) **Nullkuponwertpapier.**

(b) **Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.**

(c) **Mit dem Fonds verbunden.**

(d) **Wertpapiere mit einem gesamten beizulegenden Zeitwert von 791.485 USD (31. Dezember 2022: 734.559 USD) wurden zum 30. Juni 2023 gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen als Sicherheit für Pensionsgeschäfte verpfändet.**

Wertpapier mit einem gesamten beizulegenden Zeitwert von null USD (31. Dezember 2022: 9.544 USD) wurde zum 30. Juni 2023 gemäß den Rahmenverträgen als Sicherheit für Wertpapier-Termingeschäfte für verzögert gelieferte Wertpapiere oder Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte verpfändet oder geliefert.

Wertpapier mit einem gesamten beizulegenden Zeitwert von null USD (31. Dezember 2022: 101 USD) wurde zum 30. Juni 2023 gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte als Sicherheit erhalten.

Barmittel in Höhe von 30.047 USD (31. Dezember 2022: 24.192 USD) wurden zum 30. Juni 2023 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Barmittel in Höhe von 17.910 USD (31. Dezember 2022: 21.490 USD) wurden zum 30. Juni 2023 gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. als Sicherheit für Finanzderivate verpfändet.

Beizulegender Zeitwert[1]

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 30. Juni 2023 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie[2]	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	$ 0	$ 3.401.573	$ 4	$ 3.401.577
Investmentfonds	10.161	0	0	10.161
Pensionsgeschäfte	0	2.272	0	2.272
Finanzderivate[3]	3.780	1.844	0	5.624
Summen	**$ 13.941**	**$ 3.405.689**	**$ 4**	**$ 3.419.634**

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

Kategorie[2]	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	$ 0	$ 3.391.396	$ 0	$ 3.391.396
Investmentfonds	7.043	0	0	7.043
Pensionsgeschäfte	0	2.245	0	2.245
Finanzderivate[3]	(4.808)	18.214	0	13.406
Summen	**$ 2.235**	**$ 3.411.855**	**$ 0**	**$ 3.414.090**

(1) Weitere Informationen finden Sie in den Erläuterungen in Erläuterung 3.

(2) Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung des Wertpapierbestands.

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

Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2023:

Kontrahent	Kredit-zins	Abrechnungs-datum	Fälligkeits-datum	Kredit-betrag	Verbindlichkeiten aus umgekehrten Pensions-geschäften	% des Nettovermögens
BOS	5,180 %	14.06.2023	05.07.2023	$ (10.841)	$ (10.867)	(0,43)
BSN	5,180	04.05.2023	06.07.2023	(544.125)	(548.666)	(21,85)
CIB	5,170	15.06.2023	27.07.2023	(19.174)	(19.218)	(0,77)
GRE	5,170	20.06.2023	06.07.2023	(34.190)	(34.244)	(1,37)
NOM	5,200	17.05.2023	17.07.2023	(177.163)	(178.315)	(7,10)
Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte					**$ (791.310)**	**(31,52)**

Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC-Derivate und -Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2023 und 31. Dezember 2022:

	Zum 30. Jun. 2023			Zum 31. Dez. 2022		
Kontrahent	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-engagement[1]	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-engagement[1]
AZD	$ (10)	$ 0	$ (10)	$ k. A.	$ k. A.	$ k. A.
BOA	3.934	(2.880)	1.054	3.056	(2.990)	66
BOM	k. A.	k. A.	k. A.	110	0	110
BPS	13.047	(11.300)	1.747	(381)	580	199
BRC	(25)	0	(25)	(156)	130	(26)
CBK	(699)	630	(69)	11.029	(10.872)	157
DUB	(3.901)	3.710	(191)	(3.859)	3.720	(139)
FAR	(591)	810	219	k. A.	k. A.	k. A.
GLM	(405)	270	(135)	(1.194)	610	(584)
GST	(2)	0	(2)	(2.425)	2.410	(15)
IND	(834)	850	16	k. A.	k. A.	k. A.
JPM	518	(530)	(12)	(2.608)	2.180	(428)
MBC	4.005	(2.910)	1.095	8.954	(8.240)	714
MYC	k. A.	k. A.	k. A.	(36)	90	54
MYI	(12.764)	8.350	(4.414)	(3.890)	2.910	(980)
RBC	k. A.	k. A.	k. A.	44	0	44
SAL	(28)	130	102	(20)	130	110
SCX	(241)	60	(181)	(7.751)	7.310	(441)
SOG	(4.201)	3.100	(1.101)	k. A.	k. A.	k. A.
TOR	(38)	0	(38)	(270)	1.420	1.150
UAG	89	0	89	18	0	18

(1) Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären.

Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung des Wertpapierbestands zum 30. Juni 2023:

	30. Jun. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	118,68	115,82
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	16,79	15,81
Sonstige übertragbare Wertpapiere	0,02	0,25
Investmentfonds	0,40	0,27
Pensionsgeschäfte	0,09	0,09
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	0,31	(0,09)
Zentral abgerechnete Finanzderivate	0,00	0,58
Freiverkehrsfinanzderivate	(0,09)	0,02
Umgekehrte Pensionsgeschäfte	(31,52)	(30,96)
Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte	k. A.	(0,37)

Das Anlageportfolio des Fonds konzentriert sich zum 30. Juni 2023 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	30. Jun. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
Australien	1,08	1,83
Belgien	0,07	0,07
Kanada	1,50	1,46
Cayman-Inseln	1,39	1,58
Dänemark	2,89	4,20
Frankreich	8,98	7,82
Deutschland	0,94	0,86
Irland	8,68	8,54
Italien	9,09	7,79
Japan	4,12	4,27
Luxemburg	k. A.	0,02
Niederlande	0,69	0,71
Neuseeland	1,68	1,63
Peru	0,01	0,07
Slowenien	0,04	0,04
Spanien	1,84	1,71
Schweden	1,14	1,15
Schweiz	0,16	k. A.
Großbritannien	25,38	25,93
USA	65,55	62,20
Kurzfristige Instrumente	0,26	k. A.
Investmentfonds	0,40	0,27
Pensionsgeschäfte	0,09	0,09
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	0,33	(0,09)
Verkaufsoptionen		
Optionen auf börsengehandelte Terminkontrakte	(0,02)	k. A.
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	0,00	0,00
Zinsswaps	0,00	0,58
Freiverkehrsfinanzderivate		
Optionskauf		
Zinsswapoptionen	0,24	0,46
Verkaufsoptionen		
Inflation-Capped Options	(0,02)	(0,02)
Zinsswapoptionen	(0,42)	(0,88)
Credit Default Swaps auf Kreditindizes— Schutzverkauf	0,00	0,00
Devisenterminkontrakte	(0,97)	(0,96)
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	1,08	1,42
Sonstige Aktiva und Passiva	(36,20)	(32,75)
Nettovermögen	100,00	100,00

BESCHREIBUNG		PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE				
KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG				
American Airlines, Inc.				
10,000 % fällig am 20.04.2028	$	65.500	$ 66.986	0,10
Avolon TLB Borrower (U.S.) LLC				
6,896 % fällig am 15.01.2025		21.326	21.338	0,03
7,396 % fällig am 01.12.2027		4.113	4.113	0,01
Carnival Corp.				
7,168 % fällig am 30.06.2025	€	61.232	66.623	0,10
8,217 % fällig am 30.06.2025	$	128.780	128.720	0,20
8,467 % fällig am 18.10.2028		20.382	20.238	0,03
Cengage Learning, Inc.				
9,880 % fällig am 14.07.2026		28.816	28.299	0,04
Charter Communications Operating LLC				
6,795 % - 6,834 % fällig am 01.02.2027		36.956	36.778	0,06
Delos Finance SARL				
7,288 % fällig am 06.10.2023		8.226	8.232	0,01
Diamond Sports Group LLC				
13,064 % fällig am 25.05.2026		4.030	3.119	0,00
Directv Financing LLC				
10,217 % fällig am 02.08.2027		37.426	36.672	0,06
Emerald TopCo, Inc.				
8,584 % fällig am 24.07.2026		3.576	3.484	0,01
Envision Healthcare Corp.				
16,070 % fällig am 29.04.2027		48.738	58.121	0,09
16,695 % fällig am 28.04.2028 ^		126.964	93.585	0,15
iHeartCommunications, Inc.				
8,217 % fällig am 01.05.2026		256.669	222.965	0,35
8,469 % fällig am 01.05.2026		23.246	20.248	0,03
Instant Brands Holdings, Inc.				
TBD % fällig am 12.04.2028 ^		250	55	0,00
15,217 % fällig am 12.12.2023		104	96	0,00
Intelsat Jackson Holdings S.A.				
9,443 % fällig am 01.02.2029		83.574	83.342	0,13
IQVIA, Inc.				
5,598 % fällig am 07.03.2024	€	5.000	5.456	0,01
Lealand Finance Co. BV				
8,193 % fällig am 28.06.2024	$	2.771	2.217	0,00
Lealand Finance Co. BV (2,666 % bar oder 3,000 % PIK)				
3,000 % - 6,193 % fällig am 30.06.2025 (d)		6.605	3.853	0,01
Poseidon BidCo S.A.S				
8,848 % fällig am 14.07.2028	€	103.800	110.981	0,17
PUG LLC				
8,525 % fällig am 12.02.2027	$	13.119	11.736	0,02
9,443 % fällig am 12.02.2027		980	889	0,00
Redstone Holdco 2 LP				
10,005 % fällig am 27.04.2028		7.192	6.020	0,01
RegionalCare Hospital Partners Holdings, Inc.				
9,023 % fällig am 16.11.2025		5.539	5.143	0,01
SCUR-Alpha 1503 GmbH				
9,087 % fällig am 29.03.2030	€	62.100	64.775	0,10
10,602 % fällig am 28.03.2030	$	113.416	107.603	0,17
Serta Simmons Bedding LLC				
8,098 % - 8,117 % fällig am 08.11.2023		1.410	60	0,00
Sierra Hamilton LLC				
15,000 % fällig am 12.09.2023		1	1	0,00
Sigma Bidco BV				
6,239 % fällig am 02.07.2025	€	8.990	9.621	0,02
Sotera Health Holdings LLC				
8,023 % fällig am 11.12.2026	$	17.409	17.188	0,03
SS&C European Holdings SARL				
6,967 % fällig am 16.04.2025		8.421	8.425	0,01
SS&C Technologies, Inc.				
6,967 % fällig am 16.04.2025		14.950	14.956	0,02
Sunshine Luxembourg SARL				
9,092 % fällig am 01.10.2026		10.958	10.917	0,02
Surgery Center Holdings, Inc.				
8,896 % fällig am 31.08.2026		8.962	8.961	0,01
Syniverse Holdings, Inc.				
12,242 % fällig am 13.05.2027		30.101	27.684	0,04
Team Health Holdings, Inc.				
7,943 % fällig am 06.02.2024		22.185	19.730	0,03
TransDigm, Inc.				
8,492 % fällig am 22.02.2027	$	36.758	$ 36.813	0,06
8,492 % fällig am 24.08.2028		83.591	83.639	0,13
U.S. Renal Care, Inc.				
10,192 % fällig am 26.06.2026		23.013	10.797	0,02
10,693 % fällig am 26.06.2026		6.541	3.069	0,00
United Airlines, Inc.				
9,292 % fällig am 21.04.2028		19.902	19.924	0,03
Veritas U.S., Inc.				
10,217 % fällig am 01.09.2025		1.986	1.629	0,00
Wesco Aircraft Holdings, Inc.				
TBD % - 13,725 % fällig am 01.03.2024 µ		7.020	7.020	0,01
Westmoreland Coal Co. (15,000 % PIK)				
TBD % fällig am 15.03.2029 (d)		4.405	3.249	0,01
Windstream Services LLC				
11,452 % fällig am 21.09.2027		27.250	25.513	0,04
Wm Morrison Supermarkets Ltd.				
8,073 % fällig am 04.11.2027	€	112.376	105.508	0,16
Zayo Group Holdings, Inc.				
8,217 % fällig am 09.03.2027	$	1.317	1.038	0,00
			1.637.429	2,54
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
BANKEN UND FINANZEN				
Adler Financing SARL				
12,500 % fällig am 30.06.2025	€	903	1.011	0,00
AGFC Capital Trust				
7,010 % fällig am 15.01.2067	$	23.000	12.400	0,02
AGPS BondCo PLC				
5,000 % fällig am 27.04.2027 ^	€	1.100	426	0,00
5,500 % fällig am 13.11.2026 ^		200	84	0,00
Ambac Assurance Corp.				
5,100 % (i)	$	0	0	0,00
American Assets Trust LP				
3,375 % fällig am 01.02.2031		5.500	4.308	0,01
Armor Holdco, Inc.				
8,500 % fällig am 15.11.2029		800	665	0,00
Army Hawaii Family Housing Trust Certificates				
5,593 % fällig am 15.06.2050		102.600	71.245	0,11
Aroundtown S.A.				
5,375 % fällig am 21.03.2029		33.840	25.075	0,04
Asian Development Bank				
4,700 % fällig am 12.03.2024	MXN	99.000	5.459	0,01
Avolon Holdings Funding Ltd.				
2,528 % fällig am 18.11.2027	$	165.597	139.794	0,22
Banca Monte dei Paschi di Siena SpA				
1,875 % fällig am 09.01.2026	€	33.400	32.452	0,05
2,625 % fällig am 28.04.2025		5.400	5.531	0,01
3,625 % fällig am 24.09.2024		4.800	5.089	0,01
6,750 % fällig am 02.03.2026		129.460	141.565	0,22
7,677 % fällig am 18.01.2028		5.000	4.597	0,01
8,000 % fällig am 22.01.2030		26.444	25.942	0,04
8,500 % fällig am 10.09.2030		12.200	12.047	0,02
Banco de Credito del Peru S.A.				
4,650 % fällig am 17.09.2024	PEN	95.500	25.261	0,04
Banco Espirito Santo S.A.				
2,625 % fällig am 08.05.2017 ^	€	16.200	4.330	0,01
4,750 % fällig am 15.01.2018 ^		8.100	2.165	0,00
Bank of Nova Scotia				
4,900 % fällig am 04.06.2025 (i)(k)	$	3.346	3.167	0,01
Barclays PLC				
4,972 % fällig am 16.05.2029		79.515	75.216	0,12
7,437 % fällig am 02.11.2033		35.850	38.805	0,06
7,750 % fällig am 15.09.2023 (i)(k)		48.538	47.684	0,07
Bevco Lux SARL				
1,000 % fällig am 16.01.2030	€	15.000	$ 12.766	0,02
BNP Paribas Issuance BV				
0,000 % fällig am 09.04.2029	$	10	1.638.261	2,54
CaixaBank S.A.				
6,208 % fällig am 18.01.2029		64.050	63.955	0,10
CIFI Holdings Group Co. Ltd.				
4,375 % fällig am 12.04.2027 ^		2.000	232	0,00
4,450 % fällig am 17.08.2026 ^		1.700	193	0,00
4,800 % fällig am 17.05.2028 ^		700	81	0,00
5,250 % fällig am 13.05.2026 ^		1.100	128	0,00
5,950 % fällig am 20.10.2025 ^		1.300	151	0,00
6,000 % fällig am 16.07.2025 ^		2.000	227	0,00
6,450 % fällig am 07.11.2024 ^		3.300	388	0,00
Corestate Capital Holding S.A.				
3,500 % fällig am 31.07.2023 ^	€	30.000	4.623	0,01
Country Garden Holdings Co. Ltd.				
2,700 % fällig am 12.07.2026	$	8.400	2.572	0,00
3,125 % fällig am 22.10.2025		13.400	4.223	0,01
3,875 % fällig am 22.10.2030		6.400	1.830	0,00
4,800 % fällig am 06.08.2030		1.000	290	0,00
5,125 % fällig am 17.01.2025		1.600	704	0,00
5,400 % fällig am 27.05.2025		1.600	593	0,00
5,625 % fällig am 14.01.2030		700	219	0,00
6,150 % fällig am 17.09.2025		1.000	330	0,00
6,500 % fällig am 08.04.2024		500	297	0,00
8,000 % fällig am 27.01.2024		2.800	1.840	0,00
CPI Property Group S.A.				
1,500 % fällig am 27.01.2031	€	2.200	1.309	0,00
2,750 % fällig am 12.05.2026		2.600	2.309	0,00
2,750 % fällig am 22.01.2028	£	1.700	1.448	0,00
Credit Suisse AG				
0,495 % fällig am 02.02.2024	$	17.400	16.742	0,03
5,500 % fällig am 20.08.2026	€	179.400	198.934	0,31
6,500 % fällig am 08.08.2023 (k)	$	59.125	58.909	0,09
Credit Suisse AG AT1 Claim ^		138.872	5.555	0,01
Deutsche Bank AG				
1,375 % fällig am 17.02.2032	€	39.900	32.298	0,05
1,750 % fällig am 19.11.2030		5.000	4.317	0,01
2,129 % fällig am 24.11.2026 (m)	$	24.300	21.631	0,03
3,035 % fällig am 28.05.2032 (m)(n)		45.920	36.192	0,06
3,547 % fällig am 18.09.2031		20.300	16.871	0,03
6,720 % fällig am 18.01.2029		34.800	34.877	0,05
EPR Properties				
4,750 % fällig am 15.12.2026		7.623	6.944	0,01
4,950 % fällig am 15.04.2028		2.170	1.941	0,00
Erste Group Bank AG				
4,250 % fällig am 15.10.2027 (i)(k)	€	29.000	24.131	0,04
Essential Properties LP				
2,950 % fällig am 15.07.2031	$	4.000	3.002	0,01
Fairfax Financial Holdings Ltd.				
3,950 % fällig am 03.03.2031	CAD	3.940	2.588	0,00
Ford Motor Credit Co. LLC				
2,748 % fällig am 14.06.2024	£	17.601	21.417	0,03
Gateway Casinos & Entertainment Ltd.				
5,000 % fällig am 12.03.2038	CAD	47.146	32.302	0,05
GLP Capital LP				
3,250 % fällig am 15.01.2032	$	4.100	3.315	0,01
4,000 % fällig am 15.01.2031		15.815	13.687	0,02
5,250 % fällig am 01.06.2025		3.502	3.433	0,01
5,300 % fällig am 15.01.2029		16.214	15.453	0,02
Goodman U.S. Finance Three LLC				
3,700 % fällig am 15.03.2028		11.640	10.564	0,02
HSBC Holdings PLC				
2,357 % fällig am 18.08.2031		46.700	37.304	0,06

BESCHREIBUNG		PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
2,804 % fällig am 24.05.2032	$	25.700	$ 20.799	0,03
2,848 % fällig am 04.06.2031		3.600	2.989	0,00
3,973 % fällig am 22.05.2030		46.600	41.889	0,07
4,583 % fällig am 19.06.2029		15.300	14.413	0,02
5,402 % fällig am 11.08.2033		7.000	6.848	0,01
6,254 % fällig am 09.03.2034		126.700	129.945	0,20
Huarong Finance Co. Ltd.				
4,500 % fällig am 29.05.2029		4.216	3.383	0,01
Hudson Pacific Properties LP				
3,950 % fällig am 01.11.2027		2.700	1.966	0,00
5,950 % fällig am 15.02.2028		1.600	1.273	0,00
InCaps Funding Ltd.				
7,496 % fällig am 01.06.2033		2.203	2.027	0,00
International Finance Corp.				
8,000 % fällig am 09.10.2023	IDR	129.400.000	8.668	0,01
Intesa Sanpaolo SpA				
8,248 % fällig am 21.11.2033	$	3.900	4.099	0,01
KBC Group NV				
5,796 % fällig am 19.01.2029		7.150	7.108	0,01
Kennedy Wilson Europe Real Estate Ltd.				
3,250 % fällig am 12.11.2025	€	9.400	9.100	0,01
Lloyds Banking Group PLC				
7,875 % fällig am 27.06.2029 (i)(k)	£	28.220	31.827	0,05
Morgan Stanley				
0,000 % fällig am 02.04.2032 (m)	$	68.500	42.809	0,07
National Health Investors, Inc.				
3,000 % fällig am 01.02.2031		9.900	7.609	0,01
Nationwide Building Society				
3,960 % fällig am 18.07.2030		163.883	145.589	0,23
4,302 % fällig am 08.03.2029		34.100	31.625	0,05
NatWest Group PLC				
4,445 % fällig am 08.05.2030		121.125	111.446	0,17
4,892 % fällig am 18.05.2029		62.833	59.837	0,09
5,076 % fällig am 27.01.2030		134.670	128.589	0,20
6,016 % fällig am 02.03.2034		62.800	63.177	0,10
Navient Corp.				
5,625 % fällig am 25.01.2025		3.549	3.233	0,01
New Metro Global Ltd.				
4,500 % fällig am 02.05.2026		4.600	1.944	0,00
4,625 % fällig am 15.10.2025		800	404	0,00
4,800 % fällig am 15.12.2024		7.900	5.409	0,01
6,800 % fällig am 05.08.2023		3.100	3.023	0,00
Nissan Motor Acceptance Co. LLC				
2,750 % fällig am 09.03.2028		21.400	17.604	0,03
Nomura Holdings, Inc.				
2,172 % fällig am 14.07.2028		14.968	12.641	0,02
Nordea Kredit Realkreditaktieselskab				
2,000 % fällig am 01.10.2047	DKK	0	0	0,00
Nykredit Realkredit A/S				
2,000 % fällig am 01.07.2037	DKK	0	$ 0	0,00
2,000 % fällig am 01.10.2047		0	0	0,00
OneMain Finance Corp.				
6,125 % fällig am 15.03.2024	$	14.595	14.558	0,02
Park Aerospace Holdings Ltd.				
5,500 % fällig am 15.02.2024		13.831	13.677	0,02
Preferred Term Securities Ltd.				
5,752 % fällig am 22.12.2036		373	338	0,00
5,842 % fällig am 22.06.2037		14.382	12.440	0,02
5,852 % fällig am 22.03.2037		16.877	14.852	0,02
5,852 % fällig am 22.09.2037		16.562	13.506	0,02
5,862 % fällig am 22.12.2036		20.162	18.750	0,03
5,892 % fällig am 22.09.2036		1.323	1.200	0,00
5,902 % fällig am 22.12.2035		9.433	8.584	0,01
5,902 % fällig am 22.03.2038		9.188	8.361	0,01
5,922 % fällig am 22.09.2037		11.820	8.983	0,01
5,932 % fällig am 23.09.2035		711	702	0,00
5,932 % fällig am 22.03.2037		13.164	9.609	0,02
5,952 % fällig am 22.03.2038		13.055	10.968	0,02
5,982 % fällig am 22.12.2035		2.180	1.799	0,00
6,002 % fällig am 22.03.2038		9.208	7.872	0,01
6,032 % fällig am 23.09.2035		6.666	5.833	0,01
6,132 % fällig am 23.03.2035		10.000	8.650	0,01
6,381 % fällig am 03.07.2033		499	462	0,00
6,452 % fällig am 22.03.2038		739	699	0,00
Realkredit Danmark A/S				
2,500 % fällig am 01.04.2047	DKK	0	0	0,00
Santander UK Group Holdings PLC				
2,469 % fällig am 11.01.2028	$	5.600	4.894	0,01
3,823 % fällig am 03.11.2028		17.900	16.128	0,03
6,534 % fällig am 10.01.2029		47.000	47.371	0,07
6,750 % fällig am 24.06.2024 (i)(k)	£	65.803	78.472	0,12
SBA Tower Trust				
2,836 % fällig am 15.01.2050	$	5.885	5.590	0,01
Sberbank of Russia Via SB Capital S.A.				
5,125 % fällig am 29.10.2022 ^		6.100	366	0,00
Seazen Group Ltd.				
4,450 % fällig am 13.07.2025		1.900	988	0,00
6,000 % fällig am 12.08.2024		5.000	3.573	0,01
SLM Corp.				
4,200 % fällig am 29.10.2025		2.686	2.498	0,00
SLM Student Loan Trust				
4,076 % fällig am 15.12.2033	€	11.621	11.700	0,02
Societe Generale S.A.				
2,889 % fällig am 09.06.2032	$	14.300	11.216	0,02
6,446 % fällig am 10.01.2029		51.300	51.429	0,08
6,447 % fällig am 12.01.2027		42.900	42.824	0,07
6,691 % fällig am 10.01.2034		137.100	139.676	0,22
Standard Chartered PLC				
2,678 % fällig am 29.06.2032		3.500	2.745	0,00
Stichting AK Rabobank Certificaten				
6,500 % (i)	€	206.326	209.289	0,32
Sunac China Holdings Ltd.				
6,500 % fällig am 10.01.2025 ^	$	1.700	257	0,00
6,500 % fällig am 26.01.2026 ^		600	91	0,00
6,650 % fällig am 03.08.2024 ^		700	103	0,00
7,500 % fällig am 01.02.2024 ^		800	120	0,00
8,350 % fällig am 19.04.2023 ^		5.300	784	0,00
SVB Financial Group				
3,125 % fällig am 05.06.2030 ^		300	198	0,00
U.S. Capital Funding Ltd.				
5,491 % fällig am 10.07.2043		5.056	3.824	0,01
6,049 % fällig am 01.08.2034		400	394	0,00
UBS AG				
5,125 % fällig am 15.05.2024 (k)		49.785	49.025	0,08
UBS Group AG				
2,746 % fällig am 11.02.2033		3.116	2.429	0,00
2,875 % fällig am 02.04.2032	€	1.500	1.428	0,00
3,091 % fällig am 14.05.2032	$	57.350	46.416	0,07
3,750 % fällig am 26.03.2025		20.900	20.014	0,03
3,869 % fällig am 12.01.2029		5.750	5.203	0,01
4,194 % fällig am 01.04.2031		35.450	31.571	0,05
5,959 % fällig am 12.01.2034		93.281	92.849	0,14
6,373 % fällig am 15.07.2026		32.250	32.054	0,05
6,442 % fällig am 11.08.2028		115.850	116.375	0,18
6,537 % fällig am 12.08.2033		102.073	104.626	0,16
7,375 % fällig am 07.09.2033	£	24.000	31.982	0,05
7,750 % fällig am 01.03.2029	€	124.330	$ 150.435	0,23
9,016 % fällig am 15.11.2033	$	38.550	46.236	0,07
UniCredit SpA				
7,830 % fällig am 04.12.2023		324.870	326.823	0,51
Unique Pub Finance Co. PLC				
7,395 % fällig am 28.03.2024	£	2.282	2.909	0,00
Uniti Group LP				
4,750 % fällig am 15.04.2028	$	11.366	9.443	0,01
10,500 % fällig am 15.02.2028		72.952	72.439	0,11
VICI Properties LP				
3,500 % fällig am 15.02.2025		42.516	40.662	0,06
3,750 % fällig am 15.02.2027		39.100	35.903	0,06
3,875 % fällig am 15.02.2029		13.080	11.490	0,02
4,125 % fällig am 15.08.2030		10.116	8.916	0,01
4,250 % fällig am 01.12.2026		31.400	29.402	0,05
4,500 % fällig am 01.09.2026		11.028	10.428	0,02
4,500 % fällig am 15.01.2028		900	828	0,00
4,625 % fällig am 15.06.2025		5.648	5.462	0,01
4,625 % fällig am 01.12.2029		32.600	29.626	0,05
5,625 % fällig am 01.05.2024		9.505	9.455	0,02
5,750 % fällig am 01.02.2027		25.355	24.841	0,04
Voyager Aviation Holdings LLC				
8,500 % fällig am 09.05.2026		4.668	3.688	0,01
Yango Group Co. Ltd.				
6,900 % fällig am 31.10.2022 ^	CNY	50.000	366	0,00
			6.096.664	9,45
INDUSTRIEWERTE				
Air Canada Pass-Through Trust				
5,250 % fällig am 01.10.2030	$	27.653	26.843	0,04
Alaska Airlines Pass-Through Trust				
4,800 % fällig am 15.02.2029		15.979	15.371	0,02
Altice Financing S.A.				
5,750 % fällig am 15.08.2029		71.503	55.465	0,09
Altice France S.A.				
8,125 % fällig am 01.02.2027		24.392	21.149	0,03
Amdocs Ltd.				
2,538 % fällig am 15.06.2030		3.500	2.925	0,01
American Airlines Pass-Through Trust				
2,875 % fällig am 11.01.2036		17.916	15.014	0,02
3,000 % fällig am 15.04.2030		1.694	1.504	0,00
3,150 % fällig am 15.08.2033		754	658	0,00
3,350 % fällig am 15.04.2031		10.219	9.097	0,01
3,375 % fällig am 01.11.2028		23.990	21.540	0,03
3,575 % fällig am 15.07.2029		3.734	3.465	0,01
3,700 % fällig am 01.04.2028		30.769	27.707	0,04
4,000 % fällig am 15.08.2030		5.254	4.559	0,01
Amgen, Inc.				
5,600 % fällig am 02.03.2043		12.200	12.245	0,02
5,750 % fällig am 02.03.2063		4.300	4.365	0,01
Baptist Healthcare System Obligated Group				
3,540 % fällig am 15.08.2050		13.100	9.712	0,02
Boeing Co.				
5,705 % fällig am 01.05.2040		40.715	40.644	0,06
5,805 % fällig am 01.05.2050		151.967	151.541	0,24
5,930 % fällig am 01.05.2060		114.118	113.112	0,18
6,125 % fällig am 15.02.2033		14.822	15.463	0,02
British Airways Pass-Through Trust				
2,900 % fällig am 15.09.2036		7.256	5.998	0,01
3,300 % fällig am 15.06.2034		3.327	2.892	0,00
3,800 % fällig am 20.03.2033		2.449	2.233	0,00
4,250 % fällig am 15.05.2034		6.536	5.974	0,01
Broadcom, Inc.				
2,450 % fällig am 15.02.2031		44.100	35.885	0,06
2,600 % fällig am 15.02.2033		13.200	10.325	0,02
3,137 % fällig am 15.11.2035		3.818	2.930	0,00
3,187 % fällig am 15.11.2036		69.706	52.720	0,08
3,419 % fällig am 15.04.2033		18.100	15.145	0,02
3,469 % fällig am 15.04.2034		78.431	64.366	0,10
3,500 % fällig am 15.02.2041		7.475	5.597	0,01
4,300 % fällig am 15.11.2032		8.400	7.708	0,01
California Institute of Technology				
4,283 % fällig am 01.09.2116		9.100	6.916	0,01
Carvana Co.				
4,875 % fällig am 01.09.2029		4.012	2.280	0,00
5,500 % fällig am 15.04.2027		40.694	27.277	0,04

BESCHREIBUNG		PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
5,875 % fällig am 01.10.2028	$	900	$ 523	0,00
10,250 % fällig am 01.05.2030		204.910	161.672	0,25
CDW LLC				
2,670 % fällig am 01.12.2026		7.600	6.833	0,01
3,569 % fällig am 01.12.2031		26.300	22.230	0,04
Cellnex Finance Co. S.A.				
3,875 % fällig am 07.07.2041		10.300	7.556	0,01
Charter Communications Operating LLC				
3,850 % fällig am 01.04.2061		11.200	6.784	0,01
3,900 % fällig am 01.06.2052		110.300	72.277	0,11
3,950 % fällig am 30.06.2062		26.400	16.265	0,03
4,400 % fällig am 01.12.2061		44.400	30.009	0,05
Community Health Systems, Inc.				
5,625 % fällig am 15.03.2027		161.300	142.299	0,22
8,000 % fällig am 15.03.2026		102.191	99.637	0,15
Constellation Oil Services Holding S.A.				
13,500 % fällig am 30.06.2025		1.250	1.233	0,00
Constellation Oil Services Holding S.A. (3,000 % bar und 4,000 % PIK)				
3,000 % fällig am 31.12.2026 (d)		2.964	1.754	0,00
CoStar Group, Inc.				
2,800 % fällig am 15.07.2030		11.362	9.385	0,02
CVS Pass-Through Trust				
4,163 % fällig am 11.08.2036		1.407	1.215	0,00
4,704 % fällig am 10.01.2036		5.264	4.863	0,01
5,926 % fällig am 10.01.2034		741	704	0,00
6,036 % fällig am 10.12.2028		2.551	2.531	0,00
6,943 % fällig am 10.01.2030		5.141	5.241	0,01
7,507 % fällig am 10.01.2032		5.931	6.190	0,01
8,353 % fällig am 10.07.2031		4.658	5.016	0,01
DISH DBS Corp.				
5,250 % fällig am 01.12.2026		72.570	58.350	0,09
5,750 % fällig am 01.12.2028		81.200	60.547	0,09
Energy Transfer LP				
4,950 % fällig am 15.05.2028		2.500	2.421	0,00
Exela Intermediate LLC				
11,500 % fällig am 15.07.2026		5.923	563	0,00
Ford Foundation				
2,815 % fällig am 01.06.2070		7.900	4.891	0,01
Gazprom PJSC Via Gaz Capital S.A.				
2,250 % fällig am 22.11.2024	€	500	450	0,00
2,949 % fällig am 24.01.2024		56.890	52.447	0,08
4,250 % fällig am 06.04.2024 ^	£	500	562	0,00
4,950 % fällig am 23.03.2027	$	20.300	15.834	0,03
4,950 % fällig am 06.02.2028		24.600	18.326	0,03
5,150 % fällig am 11.02.2026		32.700	26.160	0,04
7,288 % fällig am 16.08.2037		18.510	15.784	0,03
8,625 % fällig am 28.04.2034		29.819	26.658	0,04
8,625 % fällig am 28.04.2034 ^		8.880	7.939	0,01
Greene King Finance PLC				
4,064 % fällig am 15.03.2035	£	3.823	3.985	0,01
5,106 % fällig am 15.03.2034		3.081	3.452	0,01
Imperial Brands Finance Netherlands BV				
1,750 % fällig am 18.03.2033	€	5.290	4.182	0,01
Imperial Brands Finance PLC				
3,500 % fällig am 26.07.2026	$	3.894	3.629	0,01
Integris Baptist Medical Center, Inc.				
3,875 % fällig am 15.08.2050		10.500	7.937	0,01
Intelsat Jackson Holdings S.A.				
6,500 % fällig am 15.03.2030		337.627	308.205	0,48
JetBlue Pass-Through Trust				
4,000 % fällig am 15.05.2034		39.190	35.794	0,06
Market Bidco Finco PLC				
4,750 % fällig am 04.11.2027	€	103.700	91.362	0,14
Massachusetts Institute of Technology				
4,678 % fällig am 01.07.2114	$	375	350	0,00
5,600 % fällig am 01.07.2111		597	675	0,00
Mitchells & Butlers Finance PLC				
6,002 % fällig am 15.12.2030		3.984	3.668	0,01
6,013 % fällig am 15.12.2030	£	5.664	6.471	0,01
Netflix, Inc.				
3,625 % fällig am 15.06.2030	€	3.700	3.848	0,01
3,875 % fällig am 15.11.2029		35.698	38.030	0,06
4,625 % fällig am 15.05.2029		13.740	15.188	0,02
Nissan Motor Co. Ltd.				
3,201 % fällig am 17.09.2028		46.600	45.679	0,07
3,522 % fällig am 17.09.2025	$	58.000	53.982	0,08
4,345 % fällig am 17.09.2027		82.724	75.297	0,12
4,810 % fällig am 17.09.2030		43.097	37.836	0,06

BESCHREIBUNG		PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
NMG Holding Co., Inc.				
7,125 % fällig am 01.04.2026	$	92.700	$ 86.384	0,13
Noble Finance LLC				
8,000 % fällig am 15.04.2030		7.084	7.209	0,01
Norfolk Southern Corp.				
4,100 % fällig am 15.05.2121		4.300	3.040	0,01
NPC Ukrenergo				
6,875 % fällig am 09.11.2028 ^		1.000	215	0,00
Oracle Corp.				
3,850 % fällig am 01.04.2060		23.840	16.817	0,03
3,950 % fällig am 25.03.2051 (m)		16.970	12.841	0,02
4,100 % fällig am 25.03.2061 (m)		25.100	18.545	0,03
PeaceHealth Obligated Group				
3,218 % fällig am 15.11.2050		13.300	8.987	0,01
Petroleos de Venezuela S.A.				
5,375 % fällig am 12.04.2027 ^		53.114	1.875	0,00
5,500 % fällig am 12.04.2037 ^		50.574	1.960	0,00
6,000 % fällig am 16.05.2024 ^		47.576	1.844	0,00
6,000 % fällig am 15.11.2026 ^		63.177	2.195	0,00
9,750 % fällig am 17.05.2035 ^		28.330	1.112	0,00
Petroleos Mexicanos				
2,750 % fällig am 21.04.2027	€	3.900	3.385	0,01
5,950 % fällig am 28.01.2031	$	43.161	31.564	0,05
6,700 % fällig am 16.02.2032		303.442	230.991	0,36
6,750 % fällig am 21.09.2047		2.466	1.551	0,00
6,950 % fällig am 28.01.2060		60.850	38.001	0,06
7,690 % fällig am 23.01.2050		9.240	6.271	0,01
Prime Healthcare Services, Inc.				
7,250 % fällig am 01.11.2025		35.984	34.146	0,05
Prosus NV				
1,985 % fällig am 13.07.2033	€	10.500	7.880	0,01
2,085 % fällig am 19.01.2030		3.900	3.335	0,01
2,778 % fällig am 19.01.2034		8.700	7.005	0,01
3,061 % fällig am 13.07.2031	$	4.600	3.598	0,01
4,193 % fällig am 19.01.2032		3.700	3.118	0,01
RegionalCare Hospital Partners Holdings, Inc.				
9,750 % fällig am 01.12.2026		2.700	2.268	0,00
Roadster Finance DAC				
2,375 % fällig am 08.12.2032	€	7.000	6.295	0,01
Rolls-Royce PLC				
4,625 % fällig am 16.02.2026		17.996	19.349	0,03
5,750 % fällig am 15.10.2027	£	13.071	15.450	0,02
Royal Caribbean Cruises Ltd.				
11,500 % fällig am 01.06.2025	$	29.833	31.680	0,05
Russian Railways Via RZD Capital PLC				
7,487 % fällig am 25.03.2031 ^	£	13.950	13.793	0,02
Sands China Ltd.				
4,300 % fällig am 08.01.2026	$	11.337	10.668	0,02
5,625 % fällig am 08.08.2025		36.476	35.609	0,06
5,900 % fällig am 08.08.2028		26.510	25.295	0,04
Sprint Spectrum Co. LLC				
4,738 % fällig am 20.09.2029		11.644	11.496	0,02
Sutter Health				
3,161 % fällig am 15.08.2040		2.900	2.194	0,00
3,361 % fällig am 15.08.2050		19.400	13.948	0,02
Syngenta Finance NV				
4,892 % fällig am 24.04.2025		4.948	4.846	0,01
Times Square Hotel Trust				
8,528 % fällig am 01.08.2026		1.480	1.464	0,00
Topaz Solar Farms LLC				
4,875 % fällig am 30.09.2039		5.496	5.056	0,01
5,750 % fällig am 30.09.2039		46.760	45.919	0,07
U.S. Airways Pass-Through Trust				
3,950 % fällig am 15.05.2027		2.676	2.498	0,00
U.S. Renal Care, Inc.				
10,625 % fällig am 15.07.2027		11.082	2.826	0,00
United Airlines Pass-Through Trust				
2,700 % fällig am 01.11.2033		19.164	16.102	0,03
3,500 % fällig am 01.09.2031		784	709	0,00
3,750 % fällig am 03.03.2028		8.012	7.532	0,01
4,000 % fällig am 11.10.2027		506	476	0,00
4,150 % fällig am 11.10.2025		333	328	0,00
4,150 % fällig am 25.02.2033		750	689	0,00
5,875 % fällig am 15.04.2029		87.140	86.499	0,13
Valaris Ltd.				
8,375 % fällig am 30.04.2030		1.327	1.333	0,00

BESCHREIBUNG		PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
Venture Global Calcasieu Pass LLC				
3,875 % fällig am 15.08.2029	$	38.600	$ 33.756	0,05
3,875 % fällig am 01.11.2033		164.200	134.680	0,21
4,125 % fällig am 15.08.2031		37.800	32.560	0,05
Venture Global LNG, Inc.				
8,125 % fällig am 01.06.2028		69.158	70.317	0,11
8,375 % fällig am 01.06.2031		69.158	69.816	0,11
Veritas U.S., Inc.				
7,500 % fällig am 01.09.2025		4.090	3.324	0,01
Viking Cruises Ltd.				
13,000 % fällig am 15.05.2025		31.212	32.794	0,05
Weir Group PLC				
2,200 % fällig am 13.05.2026		9.000	8.066	0,01
Wesco Aircraft Holdings, Inc. (7,500 % bar und 3,000 % PIK)				
10,500 % fällig am 15.11.2026 ^(d)		30.072	27.366	0,04
Wesleyan University				
4,781 % fällig am 01.07.2116		2.100	1.781	0,00
Windstream Escrow LLC				
7,750 % fällig am 15.08.2028		73.300	60.911	0,09
Wynn Macau Ltd.				
5,500 % fällig am 15.01.2026		14.700	13.670	0,02
			3.822.576	5,92

VERSORGUNGSUNTERNEHMEN

Enel Finance America LLC				
7,100 % fällig am 14.10.2027		3.200	3.365	0,01
Enel Finance International NV				
7,500 % fällig am 14.10.2032		1.700	1.886	0,00
Gazprom PJSC Via Gaz Finance PLC				
2,950 % fällig am 27.01.2029		183.800	114.875	0,18
Pacific Gas & Electric Co.				
1,700 % fällig am 15.11.2023		46.400	45.611	0,07
2,100 % fällig am 01.08.2027		7.177	6.136	0,01
2,500 % fällig am 01.02.2031		12.391	9.710	0,02
2,950 % fällig am 01.03.2026 ^		104.155	95.462	0,15
3,000 % fällig am 15.06.2028		31.800	27.440	0,04
3,150 % fällig am 01.01.2026		60.363	56.042	0,09
3,250 % fällig am 16.02.2024		66.100	64.895	0,10
3,250 % fällig am 01.06.2031		37.030	30.143	0,05
3,300 % fällig am 15.03.2027 ^		19.465	17.683	0,03
3,300 % fällig am 01.12.2027 ^		106.702	93.636	0,15
3,400 % fällig am 15.08.2024 ^		52.193	50.522	0,08
3,450 % fällig am 01.07.2025		103.044	97.341	0,15
3,500 % fällig am 15.06.2025 ^		63.544	60.188	0,09
3,500 % fällig am 01.08.2050		12.179	7.764	0,01
3,750 % fällig am 15.02.2024 ^		29.892	29.403	0,05
3,750 % fällig am 01.07.2028		113.694	101.977	0,16
3,750 % fällig am 15.08.2042 ^		20.803	14.416	0,02
3,850 % fällig am 15.11.2023 ^		17.368	17.218	0,03
3,950 % fällig am 01.12.2047 ^		4.700	3.208	0,00
4,000 % fällig am 01.12.2046 ^		16.783	11.274	0,02
4,200 % fällig am 01.03.2029		32.300	29.057	0,04
4,200 % fällig am 01.06.2041		4.900	3.657	0,01
4,250 % fällig am 01.08.2023		30.771	30.740	0,05
4,250 % fällig am 15.03.2046 ^		25.035	17.838	0,03
4,300 % fällig am 15.03.2045 ^		66.234	47.365	0,07
4,400 % fällig am 01.03.2032		33.000	28.624	0,04
4,450 % fällig am 15.04.2042 ^		33.949	25.745	0,04
4,500 % fällig am 01.07.2040		80.778	62.904	0,10
4,500 % fällig am 15.12.2041 ^		4.657	3.437	0,01
4,550 % fällig am 01.07.2030		210.515	190.679	0,30
4,600 % fällig am 15.06.2043 ^		41.543	31.486	0,05
4,650 % fällig am 01.08.2028		4.100	3.795	0,01
4,750 % fällig am 15.02.2044 ^		31.088	24.165	0,04
4,950 % fällig am 08.06.2025		15.300	14.838	0,02
4,950 % fällig am 01.07.2050		160.171	126.011	0,20
5,250 % fällig am 01.03.2052		33.000	26.863	0,04
5,450 % fällig am 15.06.2027		8.500	8.273	0,01
5,900 % fällig am 15.06.2032		10.000	9.632	0,01
Peru LNG SRL				
5,375 % fällig am 22.03.2030		600	483	0,00
Petrobras Global Finance BV				
6,250 % fällig am 14.12.2026	£	9.939	11.993	0,02
PG&E Wildfire Recovery Funding LLC				
4,263 % fällig am 01.06.2038	$	20.100	19.151	0,03
4,377 % fällig am 03.06.2041		22.200	20.563	0,03
4,451 % fällig am 01.12.2049		22.830	20.845	0,03

BESCHREIBUNG		PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
Rio Oil Finance Trust				
8,200 % fällig am 06.04.2028	$	16.055	$ 16.155	0,02
9,250 % fällig am 06.07.2024		7.935	8.012	0,01
9,750 % fällig am 06.01.2027		6.935	7.161	0,01
Sprint Capital Corp.				
8,750 % fällig am 15.03.2032		12.200	14.759	0,02
Sprint LLC				
7,125 % fällig am 15.06.2024		47.819	48.290	0,07
7,625 % fällig am 01.03.2026		20.490	21.303	0,03
7,875 % fällig am 15.09.2023		214.378	215.089	0,33
			2.049.108	3,18
Summe Unternehmensanleihen und Wechsel			11.968.348	18,55
WANDELANLEIHEN & WECHSEL				
Multiplan Corp. (6,000 % bar oder 7,000 % PIK)				
6,000 % fällig am 15.10.2027 (d)		30.000	20.370	0,03
KOMMUNALANLEIHEN UND WECHSEL				
Commonwealth of Puerto Rico General Obligation Bonds, Series 2022				
0,000 % fällig am 01.11.2043		56.528	28.547	0,05
Golden State, California Tobacco Securitization Corp. Revenue Bonds, (ST APPROP Insured), Series 2021				
3,000 % fällig am 01.06.2046		3.000	2.765	0,01
Golden State, California Tobacco Securitization Corp. Revenue Bonds, Series 2021				
3,850 % fällig am 01.06.2050		2.255	2.047	0,00
4,214 % fällig am 01.06.2050		13.300	9.977	0,02
Illinois State General Obligation Bonds, (BABs), Series 2010				
6,630 % fällig am 01.02.2035		7.334	7.661	0,01
6,725 % fällig am 01.04.2035		2.488	2.615	0,00
7,350 % fällig am 01.07.2035		7.447	8.034	0,01
Pennsylvania Higher Education Assistance Agency Revenue Bonds, (GTD STD LNS Insured), Series 2006				
5,385 % fällig am 25.10.2036		5.821	5.788	0,01
Puerto Rico Electric Power Authority Revenue Bonds, (BABs), Series 2010				
6,050 % fällig am 01.07.2032 ^		6.790	2.563	0,00
6,125 % fällig am 01.07.2040 ^		435	164	0,00
Puerto Rico Electric Power Authority Revenue Bonds, Series 2008				
5,375 % fällig am 01.07.2022 ^		2.355	883	0,00
University of California Revenue Bonds, Series 2012				
4,858 % fällig am 15.05.2112		12.280	10.948	0,02
			81.992	0,13
US-REGIERUNGSBEHÖRDEN				
Fannie Mae				
0,000 % fällig am 25.03.2035 (a)		126	4	0,00
0,000 % fällig am 25.05.2041		36	26	0,00
0,573 % fällig am 25.08.2033		183	160	0,00
0,850 % fällig am 25.10.2049 (a)		40.663	4.987	0,01
0,900 % fällig am 25.04.2044 - 25.02.2049 (a)		6.685	611	0,00
1,050 % fällig am 25.05.2048 (a)		15.349	1.977	0,00
2,500 % fällig am 25.12.2027 - 25.02.2028 (a)		4.122	155	0,00
3,000 % fällig am 25.06.2042 - 25.02.2046 (a)		519	68	0,00
3,000 % fällig am 01.09.2057		17.578	15.539	0,02
3,500 % fällig am 25.12.2049 (a)		6.100	1.353	0,00
3,500 % fällig am 01.04.2053		19.998	18.236	0,03
4,000 % fällig am 01.01.2059		9.308	8.840	0,01
4,500 % fällig am 25.09.2040		2.305	2.227	0,00
4,500 % fällig am 25.12.2042 (a)		138	24	0,00
5,000 % fällig am 01.05.2034 - 25.08.2037		6	5	0,00
5,500 % fällig am 01.05.2033 - 25.05.2038		121	123	0,00
6,000 % fällig am 01.08.2036 - 01.05.2038		0	0	0,00
6,500 % fällig am 01.03.2029		0	0	0,00
7,000 % fällig am 01.04.2029		0	0	0,00
8,697 % fällig am 25.07.2037		5	6	0,00
Freddie Mac				
0,000 % fällig am 15.01.2041		466	401	0,00
0,850 % fällig am 25.12.2049 (a)	$	23.359	$ 1.465	0,00
0,957 % fällig am 15.11.2042 (a)		3.511	339	0,00
1,007 % fällig am 15.01.2042 (a)		209	14	0,00
1,111 % fällig am 25.04.2029 (a)		42.809	1.502	0,00
1,557 % fällig am 15.03.2037 (a)		78	6	0,00
2,500 % fällig am 15.09.2027 (a)		4.594	176	0,00
3,000 % fällig am 15.12.2032 - 15.04.2049 (a)		3.800	841	0,00
3,000 % fällig am 01.11.2046 - 01.05.2049		2.147	1.928	0,00
3,103 % fällig am 25.10.2046		5.214	4.957	0,01
3,336 % fällig am 15.10.2033		389	363	0,00
3,500 % fällig am 15.12.2032 - 15.06.2049 (a)		7.752	1.202	0,00
3,500 % fällig am 01.07.2046 - 01.07.2052		24.464	22.456	0,04
4,000 % fällig am 01.04.2025 - 01.11.2047		52	51	0,00
4,000 % fällig am 15.06.2049 (a)		4.529	850	0,00
4,315 % fällig am 25.10.2052		121.728	113.224	0,18
4,419 % fällig am 25.12.2047		3.344	3.331	0,01
4,442 % fällig am 25.11.2052		141.392	134.953	0,21
4,500 % fällig am 01.08.2048		8.097	7.943	0,01
4,500 % fällig am 15.05.2049 (a)		3.555	675	0,00
5,000 % fällig am 15.02.2049 (a)		1.616	296	0,00
5,500 % fällig am 01.08.2033 - 01.04.2036		0	0	0,00
6,000 % fällig am 01.01.2033		0	0	0,00
6,500 % fällig am 01.02.2032 - 25.11.2049		2.927	3.123	0,01
7,000 % fällig am 01.12.2025 - 01.06.2037		6	2	0,00
8,000 % fällig am 01.07.2030		0	0	0,00
Ginnie Mae				
0,000 % fällig am 20.12.2040		1.824	1.505	0,00
0,000 % fällig am 20.01.2049 (a)		47.947	702	0,00
0,152 % fällig am 16.05.2050 (a)		795	2	0,00
0,992 % fällig am 16.01.2043 (a)		638	37	0,00
2,500 % fällig am 20.04.2052		61.083	52.951	0,08
2,625 % fällig am 20.07.2045		9.416	8.999	0,01
3,500 % fällig am 20.03.2043 (a)		685	106	0,00
3,500 % fällig am 20.07.2052 - 20.02.2053		449	416	0,00
3,575 % fällig am 20.07.2067		13.883	13.887	0,02
4,335 % fällig am 20.08.2066		15	15	0,00
4,508 % fällig am 20.09.2067		12.061	12.052	0,02
5,099 % fällig am 20.09.2066		18.111	18.430	0,03
5,120 % fällig am 20.07.2065		12.880	12.836	0,02
5,263 % fällig am 20.04.2037		7	7	0,00
5,283 % fällig am 20.06.2067		3.365	3.353	0,01
5,394 % fällig am 20.09.2066		8.407	8.508	0,01
5,431 % fällig am 20.06.2067		13.480	13.464	0,02
5,452 % fällig am 20.08.2066		2.651	2.644	0,00
5,616 % fällig am 20.06.2067		6.667	6.659	0,01
5,664 % fällig am 20.04.2062		400	398	0,00
5,694 % fällig am 20.01.2062		16	16	0,00
5,711 % fällig am 20.07.2066		2.213	2.202	0,00
5,894 % fällig am 20.06.2066		7.653	7.616	0,01
6,000 % fällig am 15.04.2037 - 20.11.2038		0	0	0,00
6,500 % fällig am 15.12.2023 - 15.09.2037		4	4	0,00
7,000 % fällig am 20.08.2023 - 15.05.2038		3	1	0,00
7,500 % fällig am 15.09.2023 - 20.01.2030		0	0	0,00
8,000 % fällig am 15.07.2024 - 15.05.2032		1	0	0,00
8,500 % fällig am 15.01.2031		0	0	0,00
Ginnie Mae, TBA				
2,500 % fällig am 01.07.2053		33.900	29.361	0,05
3,500 % fällig am 01.07.2053		620.000	572.954	0,89
4,000 % fällig am 01.08.2053		136.800	129.549	0,20
4,500 % fällig am 01.07.2053		161.700	156.125	0,24
5,000 % fällig am 01.08.2053		228.500	224.483	0,35
Uniform Mortgage-Backed Security				
2,500 % fällig am 01.06.2031 - 01.03.2032		296	275	0,00
3,000 % fällig am 01.02.2025 - 01.12.2052		2.513.437	2.219.914	3,44
3,500 % fällig am 01.11.2025 - 01.07.2053		1.326.261	1.212.447	1,88
4,000 % fällig am 01.08.2030 - 01.07.2053	$	1.873.780	$ 1.763.136	2,73
4,500 % fällig am 01.11.2023 - 01.08.2048		12.056	11.838	0,02
5,000 % fällig am 01.05.2026 - 01.04.2049		1.840	1.830	0,00
5,500 % fällig am 01.12.2034 - 01.06.2053		1.604.168	1.598.495	2,48
6,000 % fällig am 01.08.2031 - 01.05.2053		2.591.447	2.616.103	4,06
6,500 % fällig am 01.09.2024 - 01.07.2053		2.135.339	2.181.897	3,38
7,500 % fällig am 01.04.2029 - 01.10.2030		1	0	0,00
8,000 % fällig am 01.03.2030		0	0	0,00
8,500 % fällig am 01.04.2025		0	0	0,00
Uniform Mortgage-Backed Security, TBA				
2,000 % fällig am 01.07.2038		200	177	0,00
2,500 % fällig am 01.07.2038 - 01.08.2053		1.350	1.226	0,00
3,000 % fällig am 01.07.2038 - 01.08.2053		1.711.200	1.513.442	2,35
3,500 % fällig am 01.08.2053		3.352.284	3.058.304	4,74
4,000 % fällig am 01.07.2053		2.260.641	2.123.502	3,29
4,500 % fällig am 01.07.2053		2.633.100	2.532.957	3,93
5,000 % fällig am 01.07.2053		2.881.400	2.823.953	4,38
5,500 % fällig am 01.07.2053		3.046.803	3.031.876	4,70
6,000 % fällig am 01.07.2053		4.004.120	4.038.828	6,26
6,500 % fällig am 01.07.2053		948.090	967.937	1,50
			33.331.858	51,65
US-SCHATZOBLIGATIONEN				
U.S. Treasury Bonds				
2,500 % fällig am 15.02.2045		59.000	45.710	0,07
2,875 % fällig am 15.05.2043		69.079	57.824	0,09
2,875 % fällig am 15.08.2045		510.010	421.177	0,65
3,000 % fällig am 15.11.2044		371.252	314.382	0,49
3,000 % fällig am 15.08.2048		81.815	69.078	0,11
3,000 % fällig am 15.02.2049		10.169	8.606	0,01
3,125 % fällig am 15.02.2043		178.076	155.399	0,24
3,125 % fällig am 15.08.2044		283.117	245.140	0,38
3,125 % fällig am 15.05.2048		55.840	48.207	0,08
3,375 % fällig am 15.05.2044		416.095	375.363	0,58
3,625 % fällig am 15.02.2044		145.436	136.341	0,21
3,750 % fällig am 15.11.2043		80.988	77.446	0,12
U.S. Treasury Inflation Protected Securities (h)				
0,125 % fällig am 15.07.2024		1.165.567	1.130.738	1,75
0,125 % fällig am 15.10.2024		731.794	705.934	1,09
0,125 % fällig am 15.04.2025		166.598	158.508	0,25
0,125 % fällig am 15.07.2030		304.705	273.383	0,42
0,125 % fällig am 15.01.2031		11.186	9.946	0,02
0,125 % fällig am 15.07.2031		45.301	40.192	0,06
0,250 % fällig am 15.01.2025		394.198	377.936	0,59
0,250 % fällig am 15.07.2029		871.905	796.478	1,24
0,250 % fällig am 15.02.2050		114.556	80.223	0,12
0,375 % fällig am 15.07.2023		545.986	545.604	0,85
0,375 % fällig am 15.01.2027		19.112	17.937	0,03
0,375 % fällig am 15.07.2027 (n)		5.158	4.837	0,01
0,500 % fällig am 15.04.2024		537.186	524.227	0,81
0,625 % fällig am 15.01.2024		939.998	924.111	1,43
0,625 % fällig am 15.07.2032		507.768	466.978	0,72
0,625 % fällig am 15.02.2043		15.963	13.109	0,02
0,750 % fällig am 15.07.2028		170.180	161.321	0,25
0,750 % fällig am 15.02.2042		45.236	38.474	0,06
0,750 % fällig am 15.02.2045		150.277	124.326	0,19
0,875 % fällig am 15.01.2029		204.555	193.696	0,30
0,875 % fällig am 15.02.2047		116.227	97.624	0,15
1,000 % fällig am 15.02.2046		62.341	54.139	0,08
1,000 % fällig am 15.02.2048		138.128	118.950	0,18
1,000 % fällig am 15.02.2049		363.320	312.808	0,49
1,375 % fällig am 15.02.2044		17.439	16.443	0,03
2,125 % fällig am 15.02.2040		23.014	24.713	0,04
2,125 % fällig am 15.02.2041		10.388	11.156	0,02
U.S. Treasury Notes				
0,375 % fällig am 30.09.2027		38.660	32.910	0,05
0,500 % fällig am 31.10.2027		46.600	39.785	0,06
0,625 % fällig am 30.11.2027		542.910	465.089	0,72
0,625 % fällig am 31.12.2027		230.260	196.805	0,31
0,750 % fällig am 31.01.2028		199.210	170.920	0,27
1,500 % fällig am 15.08.2026		56.200	51.381	0,08
2,000 % fällig am 15.02.2025		15.000	14.281	0,02

BESCHREIBUNG		PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
2,000 % fällig am 15.08.2025	$	110.000	$ 103	0,16
2,000 % fällig am 15.11.2026		9.100	8.419	0,01
2,125 % fällig am 15.05.2025		132.200	125.577	0,19
2,250 % fällig am 15.11.2025		57.430	54.271	0,08
2,250 % fällig am 15.02.2027		262.600	244.249	0,38
2,375 % fällig am 31.03.2029 (n)		139.700	127.569	0,20
2,375 % fällig am 15.05.2029		255.400	232.918	0,36
2,625 % fällig am 31.01.2026		631.400	601.014	0,93
2,750 % fällig am 15.08.2032		832.400	763.256	1,18
2,875 % fällig am 15.08.2028		500	471	0,00
2,875 % fällig am 15.05.2032		171.690	159.219	0,25
4,000 % fällig am 31.10.2029		592.900	591.487	0,92
			13.161.880	20,40

NON-AGENCY-MBS

BESCHREIBUNG		PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
1211 Avenue of the Americas Trust				
3,901 % fällig am 10.08.2035		1.500	1.398	0,00
4,230 % fällig am 10.08.2035		9.600	8.732	0,01
4,280 % fällig am 10.08.2035		7.400	6.466	0,01
20 Times Square Trust				
3,203 % fällig am 15.05.2035		54.000	43.192	0,07
280 Park Avenue Mortgage Trust				
6,062 % fällig am 15.09.2034		700	679	0,00
6,432 % fällig am 15.09.2034		2.000	1.803	0,00
Adjustable Rate Mortgage Trust				
3,048 % fällig am 25.08.2035		311	227	0,00
3,280 % fällig am 25.09.2035		2.432	1.948	0,00
4,189 % fällig am 25.05.2036 ^		119	104	0,00
4,328 % fällig am 25.04.2035		5	5	0,00
4,501 % fällig am 25.01.2036		523	413	0,00
4,521 % fällig am 25.01.2036 ^		40	37	0,00
4,645 % fällig am 25.03.2037		835	696	0,00
5,390 % fällig am 25.08.2036		11.970	4.411	0,01
5,490 % fällig am 25.05.2036		5.682	2.215	0,00
5,570 % fällig am 25.06.2037		2.746	3.280	0,01
5,670 % fällig am 25.01.2036		263	245	0,00
5,690 % fällig am 25.02.2036		177	104	0,00
6,100 % fällig am 25.08.2035		1.298	1.118	0,00
6,119 % fällig am 25.11.2037 ^		781	545	0,00
6,300 % fällig am 25.01.2035 ^		1.524	1.258	0,00
6,300 % fällig am 25.03.2035		1.893	1.590	0,00
Alba PLC				
5,191 % fällig am 17.03.2039	£	6.363	7.781	0,01
5,235 % fällig am 25.11.2042		957	1.163	0,00
5,262 % fällig am 17.03.2039		2.826	3.421	0,01
5,312 % fällig am 17.03.2039		7.054	8.321	0,01
Alliance Bancorp Trust				
5,630 % fällig am 25.07.2037	$	981	837	0,00
American Home Mortgage Assets Trust				
3,209 % fällig am 25.11.2035 ^		1.077	815	0,00
4,676 % fällig am 25.02.2047		24.723	10.146	0,02
4,896 % fällig am 25.11.2046		30.753	9.490	0,02
4,916 % fällig am 25.10.2046		4.176	2.934	0,01
5,270 % fällig am 25.10.2046		6.102	5.387	0,01
5,275 % fällig am 25.03.2047		1.286	1.143	0,00
5,340 % fällig am 25.10.2046		10.293	6.417	0,01
5,340 % fällig am 25.12.2046 ^		5.296	4.494	0,01
5,360 % fällig am 25.10.2046		3.953	2.185	0,00
5,530 % fällig am 25.09.2046 ^		2.345	2.003	0,00
5,730 % fällig am 25.08.2037 ^		1.791	1.610	0,00
6,750 % fällig am 25.11.2046		5.639	4.889	0,01
American Home Mortgage Investment Trust				
5,340 % fällig am 25.05.2047		2.147	1.182	0,00
5,430 % fällig am 25.03.2046		7.493	6.471	0,01
5,510 % fällig am 25.12.2046		7.198	6.040	0,01
5,550 % fällig am 25.03.2046		2.897	2.492	0,01
5,750 % fällig am 25.09.2045		7.326	6.462	0,01
5,750 % fällig am 25.11.2045		5.528	4.009	0,01
5,883 % fällig am 25.09.2035		12.380	6.847	0,01
5,975 % fällig am 25.02.2045		7.343	6.709	0,01
6,500 % fällig am 25.03.2047		759	564	0,00
6,950 % fällig am 25.06.2036		7.599	1.290	0,00
7,129 % fällig am 25.09.2035		3.406	1.525	0,00
7,369 % fällig am 25.12.2036		4.233	3.504	0,01
Angel Oak Mortgage Trust				
1,469 % fällig am 25.06.2065		1.804	1.661	0,00
APS Resecuritization Trust				
2,818 % fällig am 27.06.2049		2.326	2.137	0,00
Ashford Hospitality Trust				
6,569 % fällig am 15.04.2035		3.000	2.916	0,01
6,719 % fällig am 15.04.2035		2.500	2.410	0,00

BESCHREIBUNG		PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
Atlas Funding PLC				
5,432 % fällig am 25.07.2058	£	21.016	$ 26.703	0,04
5,937 % fällig am 20.01.2061		24.753	31.501	0,05
Atrium Hotel Portfolio Trust				
6,373 % fällig am 15.12.2036	$	3.300	3.187	0,01
6,943 % fällig am 15.12.2036		4.000	3.775	0,01
7,743 % fällig am 15.06.2035		47.513	45.225	0,07
Avon Finance PLC				
5,809 % fällig am 20.09.2048	£	52.113	66.237	0,10
Banc of America Alternative Loan Trust				
5,500 % fällig am 25.12.2035 ^	$	158	134	0,00
5,550 % fällig am 25.01.2037 ^		1.814	1.406	0,00
5,913 % fällig am 25.10.2036		10.004	2.930	0,01
6,000 % fällig am 25.11.2035 ^		210	177	0,00
6,000 % fällig am 25.04.2037 ^		366	296	0,00
6,000 % fällig am 25.06.2037		500	415	0,00
6,000 % fällig am 25.06.2046 ^		661	582	0,00
6,000 % fällig am 25.06.2046		1.514	1.110	0,00
6,000 % fällig am 25.07.2046 ^		1.409	1.186	0,00
6,500 % fällig am 25.03.2036 ^		1.973	1.741	0,00
Banc of America Funding Corp.				
4,401 % fällig am 25.09.2048		1.657	1.540	0,00
Banc of America Funding Trust				
3,616 % fällig am 20.09.2035 ^		2.471	1.944	0,00
3,689 % fällig am 29.04.2037		7.143	6.349	0,01
3,758 % fällig am 26.10.2036		9.922	9.023	0,02
3,771 % fällig am 20.07.2047 ^		849	813	0,00
3,818 % fällig am 20.05.2036 ^		218	191	0,00
3,821 % fällig am 20.06.2047		4.797	4.143	0,01
3,826 % fällig am 20.01.2047 ^		157	131	0,00
3,846 % fällig am 20.11.2035		3.103	2.622	0,01
3,847 % fällig am 20.05.2035 ^		760	663	0,00
3,858 % fällig am 20.11.2034		6	6	0,00
3,902 % fällig am 20.09.2046 ^		86	71	0,00
3,925 % fällig am 27.08.2036		16.884	15.568	0,03
3,967 % fällig am 20.05.2036		1.210	1.136	0,00
4,046 % fällig am 20.02.2036 ^		41	33	0,00
4,102 % fällig am 20.11.2034		38	36	0,00
4,120 % fällig am 20.11.2035 ^		232	215	0,00
4,171 % fällig am 20.05.2036 ^		252	226	0,00
4,365 % fällig am 20.06.2032		3	3	0,00
4,416 % fällig am 20.01.2047 ^		1.649	1.530	0,00
4,627 % fällig am 20.07.2036		127	119	0,00
5,210 % fällig am 25.01.2037 ^		2.250	1.936	0,00
5,250 % fällig am 25.04.2037 ^		3.233	2.634	0,01
5,358 % fällig am 26.05.2037		6.806	5.983	0,01
5,398 % fällig am 26.07.2036		5.061	4.095	0,01
5,477 % fällig am 20.02.2047		3.239	2.816	0,01
5,500 % fällig am 26.07.2035		121	104	0,00
5,500 % fällig am 25.01.2036		35	33	0,00
5,500 % fällig am 25.03.2036 ^		50	42	0,00
5,537 % fällig am 20.10.2036		7.844	6.264	0,01
5,537 % fällig am 20.12.2046 ^		2.420	1.997	0,00
5,577 % fällig am 20.04.2047 ^		690	547	0,00
5,577 % fällig am 20.05.2047		6.811	6.027	0,01
5,577 % fällig am 20.06.2047		541	428	0,00
5,710 % fällig am 25.07.2037		196	179	0,00
5,717 % fällig am 20.06.2047		2.224	1.774	0,00
5,730 % fällig am 25.05.2037		4.542	3.878	0,01
5,730 % fällig am 25.07.2037		1.926	1.764	0,00
5,750 % fällig am 25.11.2035		0	0	0,00
5,750 % fällig am 25.03.2036		110	85	0,00
5,750 % fällig am 25.08.2036 ^		194	165	0,00
5,757 % fällig am 20.05.2047		1.565	1.399	0,00
5,763 % fällig am 25.10.2036		185	161	0,00
5,773 % fällig am 25.05.2037		85	76	0,00
5,846 % fällig am 25.01.2037 ^		188	163	0,00
6,000 % fällig am 25.07.2036 ^		564	389	0,00
6,000 % fällig am 25.08.2036		222	180	0,00
6,000 % fällig am 25.09.2036 ^		628	532	0,00
6,000 % fällig am 25.08.2037 ^		1.414	1.108	0,00
6,000 % fällig am 26.10.2037		1.290	1.131	0,00
6,347 % fällig am 25.01.2037		588	522	0,00
6,479 % fällig am 25.10.2036		498	423	0,00
7,480 % fällig am 20.07.2036		1.357	1.330	0,00
Banc of America Merrill Linch Trust				
3,819 % fällig am 14.07.2037		8.000	6.766	0,01
6,015 % fällig am 17.06.2050		200	43	0,00
Banc of America Mortgage Trust				
3,395 % fällig am 20.10.2046 ^		209	171	0,00
3,693 % fällig am 25.01.2036 ^		74	62	0,00

BESCHREIBUNG		PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
3,896 % fällig am 25.02.2036	$	299	$ 245	0,00
3,942 % fällig am 25.09.2035 ^		639	505	0,00
3,993 % fällig am 20.11.2046 ^		150	135	0,00
4,020 % fällig am 25.08.2035 ^		1.328	1.268	0,00
4,153 % fällig am 25.01.2035		638	612	0,00
4,370 % fällig am 25.07.2035		1.000	918	0,00
6,000 % fällig am 25.03.2037 ^		595	484	0,00
6,000 % fällig am 25.05.2037		208	163	0,00
6,000 % fällig am 25.07.2046 ^		18	15	0,00
Barclays Commercial Mortgage Securities Trust				
3,966 % fällig am 10.08.2033		7.400	6.853	0,01
7,084 % fällig am 15.07.2037		10.000	9.705	0,02
7,584 % fällig am 15.07.2037		28.583	27.246	0,04
BCAP LLC Trust				
0,000 % fällig am 26.08.2036		1.237	479	0,00
3,194 % fällig am 26.01.2037		4.198	3.579	0,01
3,596 % fällig am 26.07.2037		3.516	3.105	0,01
3,762 % fällig am 26.02.2036		791	788	0,00
3,784 % fällig am 26.03.2037		0	0	0,00
4,081 % fällig am 26.07.2037		575	516	0,00
4,203 % fällig am 26.04.2047		2.775	2.503	0,01
4,590 % fällig am 26.03.2037		191	184	0,00
5,250 % fällig am 26.05.2037		2.763	1.427	0,00
5,430 % fällig am 25.04.2037		1.547	1.402	0,00
5,490 % fällig am 25.01.2037 ^		2.635	2.426	0,01
5,500 % fällig am 26.02.2036		908	655	0,00
5,510 % fällig am 25.03.2037		6.039	5.408	0,01
5,530 % fällig am 25.10.2036		54	52	0,00
5,570 % fällig am 25.04.2037		61	55	0,00
5,570 % fällig am 25.05.2047		228	210	0,00
5,650 % fällig am 25.02.2047		1.035	897	0,00
6,250 % fällig am 26.08.2036		3.187	1.482	0,00
6,450 % fällig am 25.09.2047		1.064	932	0,00
7,550 % fällig am 25.10.2047		2.454	2.046	0,00
Bear Stearns Adjustable Rate Mortgage Trust				
3,735 % fällig am 25.05.2047 ^		117	87	0,00
3,793 % fällig am 25.08.2047 ^		1.472	1.258	0,00
3,887 % fällig am 25.05.2047 ^		3.070	2.751	0,01
3,889 % fällig am 25.07.2036 ^		201	171	0,00
3,970 % fällig am 25.03.2035		9	9	0,00
3,986 % fällig am 25.10.2046		1.583	1.322	0,00
4,065 % fällig am 25.04.2033		33	32	0,00
4,221 % fällig am 25.08.2035 ^		642	522	0,00
4,271 % fällig am 25.02.2047		2.393	2.113	0,00
4,403 % fällig am 25.10.2033		1	1	0,00
4,572 % fällig am 25.02.2036 ^		2.254	1.978	0,00
4,582 % fällig am 25.06.2035 ^		39	36	0,00
4,586 % fällig am 25.10.2035		440	423	0,00
4,831 % fällig am 25.06.2035 ^		14	13	0,00
5,137 % fällig am 25.07.2034		1	1	0,00
6,662 % fällig am 25.12.2046 ^		4.170	3.400	0,01
Bear Stearns ALT-A Trust				
3,695 % fällig am 25.05.2036 ^		978	716	0,00
3,744 % fällig am 25.04.2037		261	195	0,00
3,817 % fällig am 25.11.2036 ^		5.036	2.663	0,01
3,859 % fällig am 25.09.2035 ^		1.685	695	0,00
3,866 % fällig am 25.08.2046 ^		4.481	3.212	0,01
3,877 % fällig am 25.01.2047		550	261	0,00
3,953 % fällig am 25.09.2035 ^		3.547	1.499	0,00
3,987 % fällig am 25.09.2047		19.830	11.846	0,02
4,040 % fällig am 25.12.2046 ^		156	103	0,00
4,116 % fällig am 25.08.2036 ^		7.335	3.835	0,01
4,117 % fällig am 25.10.2035 ^		751	637	0,00
4,195 % fällig am 25.05.2035		352	333	0,00
4,202 % fällig am 25.09.2035 ^		1.569	976	0,00
4,331 % fällig am 25.09.2034		225	194	0,00
4,363 % fällig am 25.07.2035		592	504	0,00
4,365 % fällig am 25.01.2036 ^		577	526	0,00
4,433 % fällig am 25.07.2035 ^		327	240	0,00
4,577 % fällig am 25.09.2035		1.432	1.177	0,00
5,044 % fällig am 25.10.2033		2	2	0,00
5,470 % fällig am 25.08.2036		5.880	5.021	0,01
5,470 % fällig am 25.06.2046 ^		3.160	2.727	0,01
5,470 % fällig am 25.01.2047 ^		1.782	1.432	0,00
5,490 % fällig am 25.08.2036 ^		16.254	14.167	0,02
5,490 % fällig am 25.12.2046 ^		5.687	4.964	0,01
5,590 % fällig am 25.04.2036 ^		2.787	2.364	0,00
5,630 % fällig am 25.02.2036		1.064	926	0,00
5,650 % fällig am 25.01.2036 ^		691	615	0,00
5,690 % fällig am 25.10.2035		3.246	3.028	0,01
5,790 % fällig am 25.04.2034		2	2	0,00
5,850 % fällig am 25.10.2035		283	261	0,00

BESCHREIBUNG		PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
5,870 % fällig am 25.08.2035	$	4.782	$ 4.458	0,01
6,125 % fällig am 25.07.2035		1.500	1.357	0,00
6,275 % fällig am 25.01.2035		1.666	1.539	0,00
6,800 % fällig am 25.09.2034		1.111	1.068	0,00
Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust				
5,125 % fällig am 25.03.2034		342	351	0,00
5,500 % fällig am 25.08.2035		1.778	1.093	0,00
5,500 % fällig am 25.09.2035		162	138	0,00
5,500 % fällig am 25.12.2035 ^		2.884	1.461	0,00
5,550 % fällig am 25.10.2034		56	47	0,00
5,750 % fällig am 25.11.2034 ^		1.531	1.315	0,00
6,500 % fällig am 25.03.2037		1.471	1.248	0,00
Bear Stearns Mortgage Funding Trust				
5,290 % fällig am 25.03.2037		2.385	2.057	0,00
5,310 % fällig am 25.12.2046		2.942	2.416	0,00
5,310 % fällig am 25.06.2047		2.750	2.314	0,00
5,320 % fällig am 25.06.2047		6.610	5.581	0,01
5,330 % fällig am 25.10.2036		960	814	0,00
5,340 % fällig am 25.01.2037		10.128	9.198	0,02
5,550 % fällig am 25.02.2037 ^		8.959	8.084	0,01
5,550 % fällig am 25.09.2047		11.038	10.033	0,02
Bear Stearns Structured Products, Inc. Trust				
3,484 % fällig am 26.12.2046 ^		1.822	1.375	0,00
4,098 % fällig am 26.01.2036 ^		1.530	1.226	0,00
BellaVista Mortgage Trust				
5,874 % fällig am 22.01.2045		480	411	0,00
BNPP Mortgage Securities LLC Trust				
6,000 % fällig am 27.08.2037		1.143	398	0,00
Braemar Hotels & Resorts Trust				
6,138 % fällig am 15.06.2035		262	260	0,00
Brants Bridge PLC				
0,000 % fällig am 14.06.2066 (c)	£	22.000	27.836	0,04
Bridgegate Funding PLC				
6,716 % fällig am 16.10.2062		62.868	79.837	0,12
7,466 % fällig am 16.10.2062		44.065	55.332	0,09
8,466 % fällig am 16.10.2062		25.165	31.673	0,05
9,466 % fällig am 16.10.2062		18.898	23.706	0,04
BWAY Mortgage Trust				
2,917 % fällig am 10.01.2035	$	20.818	15.842	0,03
BX Trust				
6,243 % fällig am 15.05.2030		8.100	8.019	0,01
7,413 % fällig am 15.05.2035		662	648	0,00
8,468 % fällig am 15.07.2034		26.941	26.872	0,04
9,568 % fällig am 15.07.2034		2.662	2.642	0,01
BXP Trust				
3,379 % fällig am 13.06.2039		90.000	80.777	0,13
Canada Square Funding PLC				
5,316 % fällig am 17.01.2059	£	3.282	4.148	0,01
5,682 % fällig am 17.06.2058		15.541	19.652	0,03
5,852 % fällig am 17.06.2058		13.964	17.666	0,03
6,152 % fällig am 17.12.2057		10.497	13.371	0,02
Canterbury Finance PLC				
5,377 % fällig am 16.05.2058		4.457	5.660	0,01
7,111 % fällig am 16.05.2056		1.842	2.348	0,00
Cascade Funding Mortgage Trust				
4,000 % fällig am 25.10.2068	$	9.410	9.109	0,02
Chase Mortgage Finance Trust				
3,883 % fällig am 25.12.2035 ^		2.059	1.882	0,00
3,938 % fällig am 25.12.2035 ^		91	78	0,00
3,948 % fällig am 25.01.2036 ^		530	466	0,00
3,962 % fällig am 25.03.2037 ^		761	708	0,00
4,086 % fällig am 25.03.2037 ^		2.925	2.725	0,01
4,477 % fällig am 25.07.2037		151	92	0,00
4,529 % fällig am 25.07.2037		513	394	0,00
4,725 % fällig am 25.02.2037		188	178	0,00
4,739 % fällig am 25.02.2037		1.220	1.163	0,00
5,165 % fällig am 25.02.2037		1.120	1.057	0,00
5,250 % fällig am 25.05.2035		0	0	0,00
5,500 % fällig am 25.11.2035		2.177	1.638	0,00
6,000 % fällig am 25.05.2036		2.751	1.281	0,00
6,000 % fällig am 25.11.2036 ^		943	414	0,00
6,000 % fällig am 25.05.2037 ^		2.501	1.200	0,00
6,000 % fällig am 25.06.2037		5.770	2.596	0,01
ChaseFlex Trust				
4,394 % fällig am 25.09.2036		577	505	0,00
5,000 % fällig am 25.07.2037 ^		1.457	480	0,00
5,750 % fällig am 25.07.2037		6.594	5.450	0,01
6,000 % fällig am 25.02.2035		1.323	1.104	0,00
ChaseFlex Trust Multi-Class Mortgage Pass-Through Certificates Trust				
4,042 % fällig am 25.08.2037 ^	$	600	$ 508	0,00
5,610 % fällig am 25.08.2037 ^		5.538	5.083	0,01
Chester A PLC				
0,000 % fällig am 17.03.2046 (f)(m)	£	13.675	15.221	0,02
0,000 % fällig am 20.05.2046 (m)		1	5.711	0,01
5,702 % fällig am 17.03.2046 (m)		51.712	65.956	0,10
6,152 % fällig am 17.03.2046 (m)		14.727	18.645	0,03
6,652 % fällig am 17.03.2046 (m)		13.675	17.191	0,03
7,152 % fällig am 17.03.2046 (m)		8.415	10.491	0,02
7,902 % fällig am 17.03.2046 (m)		4.207	5.163	0,01
Chevy Chase Funding LLC Mortgage-Backed Certificates				
5,037 % fällig am 25.08.2035	$	725	564	0,00
5,300 % fällig am 25.01.2036		246	217	0,00
5,330 % fällig am 25.05.2036		738	659	0,00
5,350 % fällig am 25.01.2036		671	603	0,00
5,350 % fällig am 25.10.2036		958	855	0,00
5,380 % fällig am 25.10.2035		705	653	0,00
5,400 % fällig am 25.08.2035		710	663	0,00
5,420 % fällig am 25.05.2035		581	552	0,00
5,430 % fällig am 25.01.2035		327	309	0,00
5,450 % fällig am 25.08.2035		118	108	0,00
5,470 % fällig am 25.05.2035		160	149	0,00
5,510 % fällig am 25.03.2035		155	149	0,00
5,730 % fällig am 25.10.2035		336	304	0,00
5,830 % fällig am 25.10.2034		398	368	0,00
Citigroup Commercial Mortgage Trust				
0,452 % fällig am 11.03.2047 (a)		25.416	34	0,00
3,635 % fällig am 10.05.2035		7.410	6.445	0,01
6,468 % fällig am 15.12.2036		4.150	4.076	0,01
7,118 % fällig am 15.12.2036		6.675	6.416	0,01
8,118 % fällig am 15.12.2036		4.000	3.826	0,01
Citigroup Mortgage Loan Trust				
3,126 % fällig am 25.02.2037		3.198	2.362	0,00
3,223 % fällig am 25.03.2037 ^		274	236	0,00
3,564 % fällig am 25.08.2047 ^		235	202	0,00
3,584 % fällig am 25.03.2037 ^		4.104	3.525	0,01
3,839 % fällig am 25.10.2035 ^		75	65	0,00
3,853 % fällig am 25.04.2036		761	450	0,00
3,915 % fällig am 25.05.2042		945	862	0,00
3,953 % fällig am 20.02.2036		1.731	1.530	0,00
3,974 % fällig am 25.09.2037		2.232	1.931	0,00
4,001 % fällig am 25.03.2037 ^		1.267	1.096	0,00
4,100 % fällig am 25.03.2036 ^		330	301	0,00
4,145 % fällig am 25.01.2082		25.909	22.478	0,04
4,155 % fällig am 25.06.2036 ^		1.313	1.215	0,00
4,213 % fällig am 25.11.2036 ^		2.134	1.916	0,00
4,223 % fällig am 25.04.2037 ^		1.537	1.338	0,00
4,288 % fällig am 25.07.2037 ^		1.246	1.086	0,00
4,408 % fällig am 25.09.2064		13.614	10.565	0,02
4,418 % fällig am 25.08.2035 ^		378	313	0,00
4,423 % fällig am 25.07.2036 ^		130	94	0,00
5,139 % fällig am 25.11.2036		536	398	0,00
5,278 % fällig am 25.08.2036		11.161	4.599	0,01
5,280 % fällig am 25.06.2036		5.410	5.084	0,01
5,470 % fällig am 25.09.2036		343	323	0,00
5,470 % fällig am 25.01.2037		3.390	2.893	0,01
5,500 % fällig am 25.09.2035		908	880	0,00
5,650 % fällig am 25.09.2036		3.182	3.003	0,01
5,655 % fällig am 25.07.2036 ^		1.539	1.169	0,00
5,750 % fällig am 25.11.2035 ^		2.527	1.896	0,00
6,000 % fällig am 25.12.2035		1.293	1.224	0,00
6,000 % fällig am 25.11.2036		44	42	0,00
6,000 % fällig am 25.08.2037		1.367	537	0,00
Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.				
3,827 % fällig am 25.04.2035		407	383	0,00
3,928 % fällig am 25.05.2035		163	157	0,00
3,994 % fällig am 25.12.2035 ^		521	342	0,00
4,326 % fällig am 25.08.2035		2.167	1.802	0,00
Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc. Mortgage Pass-Through Certificates				
3,626 % fällig am 25.09.2035 ^		1.324	1.148	0,00
CitiMortgage Alternative Loan Trust				
5,500 % fällig am 25.04.2036		229	198	0,00
5,650 % fällig am 25.05.2037		4.093	3.287	0,01
5,700 % fällig am 25.01.2037		4.765	3.919	0,01
5,700 % fällig am 25.02.2037 ^		1.483	1.201	0,00
5,750 % fällig am 25.12.2036 ^		1.837	1.561	0,00
5,750 % fällig am 25.02.2037		538	471	0,00
5,750 % fällig am 25.03.2037		3.157	2.743	0,01
5,750 % fällig am 25.04.2037	$	3.722	$ 3.349	0,01
5,800 % fällig am 25.12.2036		1.676	1.349	0,00
6,000 % fällig am 25.07.2036		925	800	0,00
6,000 % fällig am 25.09.2036		197	171	0,00
6,000 % fällig am 25.10.2036 ^		206	177	0,00
6,000 % fällig am 25.11.2036		3.301	2.947	0,01
6,000 % fällig am 25.05.2037 ^		423	365	0,00
6,000 % fällig am 25.06.2037		6.526	5.639	0,01
Commercial Mortgage Trust				
0,250 % fällig am 10.04.2047 (a)		58.900	53	0,00
1,108 % fällig am 10.08.2046 (a)		6.232	0	0,00
1,450 % fällig am 10.10.2049 (a)		66.785	2.052	0,00
3,140 % fällig am 10.10.2036		10.000	8.730	0,01
3,178 % fällig am 10.02.2035		29.775	27.663	0,04
3,505 % fällig am 10.08.2048		7.213	6.853	0,01
3,651 % fällig am 10.02.2049		13.901	13.155	0,02
3,732 % fällig am 10.08.2049		13.175	12.317	0,02
3,961 % fällig am 10.05.2051		39.998	37.148	0,06
6,293 % fällig am 15.09.2033		10.849	9.954	0,02
Countrywide Alternative Loan Resecuritization Trust				
6,000 % fällig am 25.05.2036 ^		282	168	0,00
6,250 % fällig am 25.08.2037		1.203	636	0,00
7,000 % fällig am 25.01.2037 ^		287	62	0,00
Countrywide Alternative Loan Trust				
1,350 % fällig am 25.09.2037 (a)		831	119	0,00
1,800 % fällig am 25.10.2037 ^(a)		1.577	285	0,00
3,324 % fällig am 25.05.2035 ^		1.997	1.477	0,00
3,369 % fällig am 25.10.2035 ^		165	142	0,00
3,716 % fällig am 25.07.2021 ^		4	3	0,00
4,003 % fällig am 25.09.2034 ^		1.124	1.059	0,00
4,008 % fällig am 25.06.2037 ^		7.356	6.236	0,01
4,024 % fällig am 25.03.2047 ^		884	796	0,00
4,047 % fällig am 25.03.2047		701	607	0,00
4,048 % fällig am 20.11.2035		9.226	8.576	0,01
4,241 % fällig am 25.09.2034		33	31	0,00
4,290 % fällig am 25.04.2036 ^		196	167	0,00
4,826 % fällig am 25.11.2046		5.696	4.839	0,01
4,916 % fällig am 25.06.2046		4.646	3.747	0,01
4,976 % fällig am 25.12.2035		964	860	0,00
4,976 % fällig am 25.02.2036		135	124	0,00
5,000 % fällig am 25.08.2035 ^		2.484	1.760	0,00
5,250 % fällig am 25.06.2035		701	542	0,00
5,250 % fällig am 25.06.2035 ^		704	544	0,00
5,250 % fällig am 25.10.2035		218	150	0,00
5,286 % fällig am 20.07.2035 ^		76	67	0,00
5,326 % fällig am 25.08.2035 ^		363	289	0,00
5,337 % fällig am 20.02.2047 ^		1.750	1.366	0,00
5,347 % fällig am 20.03.2047		6.155	5.070	0,01
5,352 % fällig am 20.12.2046 ^		8.605	7.211	0,01
5,356 % fällig am 25.11.2047 ^		4.292	3.544	0,01
5,376 % fällig am 25.08.2035		693	651	0,00
5,390 % fällig am 25.06.2036		1.762	1.596	0,00
5,390 % fällig am 25.12.2046		676	588	0,00
5,410 % fällig am 25.03.2047 ^		4.532	3.523	0,01
5,430 % fällig am 25.08.2037		6.904	6.046	0,01
5,430 % fällig am 25.04.2047		5.725	5.100	0,01
5,437 % fällig am 20.09.2046		5.259	3.792	0,01
5,450 % fällig am 25.08.2035 ^		266	168	0,00
5,450 % fällig am 25.11.2035 ^		782	83	0,00
5,470 % fällig am 25.09.2047		3.403	2.957	0,01
5,490 % fällig am 25.05.2047		3.378	2.911	0,01
5,500 % fällig am 25.04.2035		2.382	2.000	0,00
5,500 % fällig am 25.05.2035 ^		3.033	2.331	0,00
5,500 % fällig am 25.05.2035		2.502	2.051	0,00
5,500 % fällig am 25.06.2035 ^		3.450	2.479	0,01
5,500 % fällig am 25.06.2035 ^		863	502	0,00
5,500 % fällig am 25.07.2035 ^		279	205	0,00
5,500 % fällig am 25.07.2035		1.616	1.307	0,00
5,500 % fällig am 25.08.2035 ^		2.856	2.271	0,00
5,500 % fällig am 25.09.2035 ^		4.748	3.540	0,01
5,500 % fällig am 25.09.2035 ^		1.924	1.181	0,00
5,500 % fällig am 25.10.2035		698	422	0,00
5,500 % fällig am 25.11.2035 ^		3.303	2.067	0,00
5,500 % fällig am 25.11.2035		11	6	0,00
5,500 % fällig am 25.12.2035		6.895	4.564	0,01
5,500 % fällig am 25.12.2035 ^		3.087	2.743	0,01
5,500 % fällig am 25.12.2035 ^		317	266	0,00
5,500 % fällig am 25.01.2036 ^		541	413	0,00
5,500 % fällig am 25.01.2036 ^		364	245	0,00
5,500 % fällig am 25.02.2036		4.778	3.327	0,01
5,500 % fällig am 25.02.2036 ^		342	265	0,00
5,500 % fällig am 25.02.2036 ^		1.308	794	0,00

BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
5,500 % fällig am 25.04.2036	$ 519	$ 404	0,00
5,500 % fällig am 25.05.2036 ^	2.140	877	0,00
5,500 % fällig am 25.10.2036 ^	1.489	693	0,00
5,500 % fällig am 25.11.2036	5.146	4.249	0,01
5,500 % fällig am 25.04.2037 ^	491	268	0,00
5,510 % fällig am 25.09.2046	1.908	1.662	0,00
5,510 % fällig am 25.05.2047	297	256	0,00
5,510 % fällig am 25.06.2047	4.772	3.948	0,01
5,520 % fällig am 25.02.2037 ^	747	228	0,00
5,530 % fällig am 25.07.2046 ^	1.385	1.341	0,00
5,530 % fällig am 25.08.2046	14.571	12.247	0,02
5,550 % fällig am 25.05.2036	4.089	3.517	0,01
5,550 % fällig am 25.12.2036 ^	4.183	896	0,00
5,550 % fällig am 25.04.2037 ^	2.048	662	0,00
5,570 % fällig am 25.07.2046	4.691	4.160	0,01
5,570 % fällig am 25.07.2046 ^	1.121	930	0,00
5,576 % fällig am 25.08.2035 ^	1.833	1.460	0,00
5,577 % fällig am 20.03.2046	5.134	4.205	0,01
5,577 % fällig am 20.05.2046 ^	15.819	13.425	0,02
5,590 % fällig am 25.09.2047	4.444	3.842	0,01
5,610 % fällig am 25.03.2036	3.112	3.006	0,01
5,610 % fällig am 25.11.2036 ^	3.395	2.946	0,01
5,621 % fällig am 25.06.2035	2.003	1.774	0,00
5,623 % fällig am 20.07.2035	1.653	1.535	0,00
5,630 % fällig am 25.07.2035	1.314	1.052	0,00
5,630 % fällig am 25.01.2037	3.351	2.731	0,01
5,650 % fällig am 25.07.2036 ^	2.285	996	0,00
5,650 % fällig am 25.09.2036	111	46	0,00
5,650 % fällig am 25.05.2037 ^	1.780	599	0,00
5,650 % fällig am 25.05.2037	149	65	0,00
5,650 % fällig am 25.06.2037	3.497	2.931	0,01
5,650 % fällig am 25.09.2037	831	334	0,00
5,650 % fällig am 25.07.2046	2.668	2.358	0,00
5,670 % fällig am 25.07.2035	1.275	1.114	0,00
5,670 % fällig am 25.12.2035	1.037	935	0,00
5,690 % fällig am 25.01.2036	2.481	2.232	0,00
5,690 % fällig am 25.07.2036	2.735	2.330	0,00
5,710 % fällig am 25.08.2035	2.943	2.615	0,01
5,710 % fällig am 25.02.2037	4.928	4.081	0,01
5,710 % fällig am 25.10.2046	7.334	6.773	0,01
5,710 % fällig am 25.08.2047 ^	5.612	4.576	0,01
5,730 % fällig am 25.02.2036 ^	1.110	983	0,00
5,750 % fällig am 25.07.2035 ^	121	78	0,00
5,750 % fällig am 25.10.2035	511	376	0,00
5,750 % fällig am 25.12.2035	1.762	1.338	0,00
5,750 % fällig am 25.01.2036	1.379	1.241	0,00
5,750 % fällig am 25.05.2036	3.291	1.394	0,00
5,750 % fällig am 25.05.2036 ^	5.663	2.394	0,00
5,750 % fällig am 25.10.2036	641	249	0,00
5,750 % fällig am 25.03.2037	579	518	0,00
5,750 % fällig am 25.03.2037 ^	2.955	1.618	0,00
5,750 % fällig am 25.06.2037	10.662	4.955	0,01
5,763 % fällig am 20.11.2035	1.399	1.303	0,00
5,770 % fällig am 25.08.2035 ^	1.361	1.215	0,00
5,790 % fällig am 25.11.2035	807	649	0,00
5,803 % fällig am 20.11.2035	8.144	7.015	0,01
5,830 % fällig am 25.09.2035	633	378	0,00
5,850 % fällig am 25.09.2035	4.466	4.038	0,01
5,850 % fällig am 25.05.2036	4.162	1.872	0,00
6,000 % fällig am 25.03.2027 ^	20	19	0,00
6,000 % fällig am 25.11.2034	3.585	3.512	0,01
6,000 % fällig am 25.12.2034	736	656	0,00
6,000 % fällig am 25.02.2035	1.352	1.153	0,00
6,000 % fällig am 25.08.2035 ^	55	25	0,00
6,000 % fällig am 25.12.2035 ^	3.831	2.898	0,01
6,000 % fällig am 25.01.2036 ^	2.024	1.464	0,00
6,000 % fällig am 25.02.2036	1.681	1.464	0,00
6,000 % fällig am 25.03.2036	3.198	1.480	0,00
6,000 % fällig am 25.04.2036 ^	6.496	3.290	0,01
6,000 % fällig am 25.04.2036	1.561	863	0,00
6,000 % fällig am 25.05.2036 ^	42	18	0,00
6,000 % fällig am 25.08.2036 ^	17.132	11.701	0,02
6,000 % fällig am 25.10.2036 ^	497	297	0,00
6,000 % fällig am 25.10.2036 ^	4.221	2.417	0,01
6,000 % fällig am 25.11.2036 ^	3.746	2.262	0,00
6,000 % fällig am 25.12.2036 ^	2.115	640	0,00
6,000 % fällig am 25.01.2037 ^	1.313	860	0,00
6,000 % fällig am 25.02.2037 ^	10.668	4.443	0,01
6,000 % fällig am 25.03.2037	1.874	786	0,00
6,000 % fällig am 25.03.2037 ^	3.194	1.340	0,00
6,000 % fällig am 25.04.2037 ^	6.861	3.989	0,01
6,000 % fällig am 25.05.2037 ^	10.871	5.301	0,01
6,000 % fällig am 25.07.2037	6.372	3.287	0,01
6,000 % fällig am 25.08.2037 ^	$ 15.873	$ 8.246	0,01
6,000 % fällig am 25.02.2047 ^	2.145	1.090	0,00
6,050 % fällig am 25.12.2036 ^	779	261	0,00
6,170 % fällig am 25.03.2037 ^	955	544	0,00
6,250 % fällig am 25.02.2036 ^	70	54	0,00
6,250 % fällig am 25.11.2036 ^	407	196	0,00
6,500 % fällig am 25.08.2032	7	7	0,00
6,500 % fällig am 25.09.2037 ^	9.273	3.811	0,01
6,610 % fällig am 25.11.2035	6.458	5.932	0,01
6,750 % fällig am 25.10.2036 ^	1.406	422	0,00
7,000 % fällig am 25.10.2037	5.680	2.152	0,00
7,500 % fällig am 25.07.2036	1.808	1.265	0,00
Countrywide Asset-Backed Certificates Trust			
5,630 % fällig am 25.04.2036 ^	794	670	0,00
5,870 % fällig am 25.11.2035	121	116	0,00
Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust			
2,050 % fällig am 25.05.2036 (a)	335	52	0,00
2,961 % fällig am 25.02.2035	2.013	1.637	0,00
3,250 % fällig am 25.05.2047	2.466	2.077	0,00
3,413 % fällig am 20.01.2035	61	53	0,00
3,514 % fällig am 25.04.2035 ^	1.715	1.319	0,00
3,656 % fällig am 25.03.2037	361	330	0,00
3,673 % fällig am 25.11.2037	1.436	1.332	0,00
3,677 % fällig am 20.02.2036	2.388	2.049	0,00
3,680 % fällig am 20.09.2036 ^	2.312	2.002	0,00
3,718 % fällig am 20.03.2036	423	343	0,00
3,787 % fällig am 25.04.2037 ^	1.642	1.479	0,00
3,793 % fällig am 20.02.2036	739	647	0,00
3,797 % fällig am 20.04.2036	1.143	997	0,00
3,810 % fällig am 25.11.2034	35	31	0,00
3,876 % fällig am 25.11.2037	1.614	1.426	0,00
3,906 % fällig am 20.04.2035	115	110	0,00
3,910 % fällig am 20.04.2035	538	500	0,00
3,927 % fällig am 20.06.2036	1.710	1.476	0,00
3,929 % fällig am 20.05.2036	1.518	1.426	0,00
3,937 % fällig am 20.05.2036 ^	1.145	1.020	0,00
4,012 % fällig am 20.12.2035	344	312	0,00
4,028 % fällig am 25.01.2036 ^	189	175	0,00
4,041 % fällig am 20.09.2035	1.378	1.234	0,00
4,070 % fällig am 20.12.2035	45	42	0,00
4,172 % fällig am 20.09.2035	84	69	0,00
4,241 % fällig am 20.10.2034	222	190	0,00
4,249 % fällig am 25.08.2034 ^	390	350	0,00
4,344 % fällig am 20.06.2035	4	4	0,00
4,344 % fällig am 20.06.2035	16	15	0,00
4,366 % fällig am 19.01.2034	8	7	0,00
4,630 % fällig am 20.10.2034	398	351	0,00
4,741 % fällig am 20.07.2034	141	129	0,00
5,450 % fällig am 25.05.2036	335	102	0,00
5,500 % fällig am 25.05.2035	586	480	0,00
5,500 % fällig am 25.09.2035 ^	414	376	0,00
5,500 % fällig am 25.10.2035 ^	913	557	0,00
5,500 % fällig am 25.11.2035 ^	494	310	0,00
5,550 % fällig am 25.08.2035	2.355	1.614	0,00
5,550 % fällig am 25.09.2037 ^	4.085	1.764	0,00
5,550 % fällig am 25.04.2046	2.283	1.922	0,00
5,630 % fällig am 25.03.2036	3.774	3.463	0,01
5,730 % fällig am 25.04.2035	1.129	1.043	0,00
5,730 % fällig am 25.04.2035	103	92	0,00
5,750 % fällig am 25.12.2035 ^	1.308	667	0,00
5,750 % fällig am 25.06.2037	1.910	1.009	0,00
5,770 % fällig am 25.03.2035	1.242	1.063	0,00
5,790 % fällig am 25.03.2035	1.606	1.413	0,00
5,810 % fällig am 25.02.2035	2.047	1.647	0,00
5,830 % fällig am 25.03.2035 ^	11	10	0,00
5,830 % fällig am 25.04.2046	6.827	2.048	0,00
5,850 % fällig am 25.02.2035	2.727	2.380	0,00
5,850 % fällig am 25.05.2036 ^	262	121	0,00
5,870 % fällig am 25.03.2035	684	597	0,00
5,890 % fällig am 25.02.2035	2.475	2.138	0,00
5,910 % fällig am 25.09.2034	105	97	0,00
6,000 % fällig am 25.04.2036	1.129	611	0,00
6,000 % fällig am 25.05.2036	2.229	1.084	0,00
6,000 % fällig am 25.07.2036	2.466	1.338	0,00
6,000 % fällig am 25.02.2037 ^	40	20	0,00
6,000 % fällig am 25.02.2037	1.444	754	0,00
6,000 % fällig am 25.03.2037	1.320	667	0,00
6,000 % fällig am 25.03.2037 ^	2.697	1.328	0,00
6,000 % fällig am 25.04.2037 ^	699	356	0,00
6,000 % fällig am 25.04.2037	1.990	1.014	0,00
6,000 % fällig am 25.05.2037 ^	8.685	4.172	0,01
6,000 % fällig am 25.07.2037 ^	31	15	0,00
6,000 % fällig am 25.07.2037	1.080	503	0,00
6,000 % fällig am 25.08.2037	$ 3.442	$ 1.622	0,00
6,000 % fällig am 25.10.2037	1.279	944	0,00
6,000 % fällig am 25.01.2038 ^	6.775	3.279	0,01
6,250 % fällig am 25.09.2036 ^	475	207	0,00
6,500 % fällig am 25.12.2037	4.820	2.119	0,00
6,537 % fällig am 20.02.2036 ^	1.657	1.516	0,00
Countrywide Home Loan Reperforming REMIC Trust			
4,237 % fällig am 25.01.2034 ^	187	153	0,00
5,570 % fällig am 25.07.2036	335	306	0,00
6,000 % fällig am 25.03.2035 ^	321	303	0,00
Countrywide Mortgage-Backed Securities, Inc.			
5,945 % fällig am 27.11.2035	265	245	0,00
Countrywide, Inc.			
5,693 % fällig am 27.11.2035	0	0	0,00
Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp.			
3,672 % fällig am 25.06.2046	23.780	21.663	0,03
4,255 % fällig am 25.03.2033	71	67	0,00
5,000 % fällig am 25.07.2035 ^	591	538	0,00
5,500 % fällig am 25.07.2035	1.417	1.294	0,00
6,000 % fällig am 25.12.2035	1.869	868	0,00
6,500 % fällig am 25.12.2035 ^	426	217	0,00
7,000 % fällig am 25.12.2035 ^	1.296	264	0,00
7,000 % fällig am 25.01.2036 ^	4.856	773	0,00
Credit Suisse First Boston Mortgage-Backed Pass-Through Certificates			
4,053 % fällig am 25.10.2033	5	5	0,00
5,582 % fällig am 25.07.2035	2.136	2.028	0,00
Credit Suisse Mortgage Capital Certificates			
3,424 % fällig am 27.02.2046	6.564	3.679	0,01
3,519 % fällig am 30.11.2037	7.521	6.905	0,01
3,778 % fällig am 26.08.2036	4.228	3.644	0,01
3,809 % fällig am 27.07.2037	730	708	0,00
3,910 % fällig am 27.02.2036	2.486	1.769	0,00
3,975 % fällig am 27.01.2036	3.219	3.065	0,01
4,255 % fällig am 26.06.2036	3.332	2.869	0,01
4,409 % fällig am 27.07.2037	1.010	932	0,00
4,847 % fällig am 27.11.2036	13.173	15.690	0,03
5,300 % fällig am 29.09.2036	292	281	0,00
5,418 % fällig am 27.10.2036	8.855	6.659	0,01
5,750 % fällig am 26.12.2035	399	290	0,00
6,000 % fällig am 25.07.2037 ^	856	717	0,00
18,431 % fällig am 27.11.2037	480	480	0,00
Credit Suisse Mortgage Capital Mortgage-Backed Trust			
5,500 % fällig am 25.08.2036 ^	1.157	833	0,00
5,942 % fällig am 25.02.2037 ^	1.037	257	0,00
6,000 % fällig am 25.10.2021 ^	11	5	0,00
6,000 % fällig am 25.03.2036 ^	4.025	1.816	0,00
6,396 % fällig am 25.04.2036	278	150	0,00
6,421 % fällig am 25.10.2037	4.347	2.697	0,01
Credit Suisse Mortgage Capital Trust			
2,500 % fällig am 25.07.2057	59.164	51.586	0,08
2,873 % fällig am 25.12.2048	12.380	10.546	0,02
2,995 % fällig am 25.07.2057	3.608	2.738	0,01
3,076 % fällig am 25.02.2056	156.511	124.398	0,19
3,105 % fällig am 25.07.2057	52.865	31.474	0,05
3,257 % fällig am 25.07.2058	276.092	215.153	0,33
3,398 % fällig am 25.09.2048	12.912	10.878	0,02
3,726 % fällig am 25.10.2058	521	439	0,00
3,806 % fällig am 25.06.2048	47.608	39.409	0,06
4,277 % fällig am 25.04.2058	51.550	46.950	0,07
4,281 % fällig am 25.09.2057	29.631	25.252	0,04
4,878 % fällig am 25.09.2057	1.248	1.073	0,00
4,953 % fällig am 01.06.2050	102.687	101.821	0,16
5,943 % fällig am 15.07.2032	31.309	29.860	0,05
6,193 % fällig am 15.07.2032	22.200	21.021	0,03
7,093 % fällig am 15.07.2032	9.193	8.348	0,01
DBUBS Mortgage Trust			
3,452 % fällig am 10.10.2034	2.000	1.809	0,00
DBWF Mortgage Trust			
6,276 % fällig am 19.12.2030	23.789	23.470	0,04
7,646 % fällig am 19.12.2030	9.300	9.096	0,02
Deutsche ALT-A Securities Mortgage Loan Trust			
5,290 % fällig am 25.07.2047	9.229	8.424	0,01
5,350 % fällig am 25.08.2047	2.820	2.538	0,01
5,390 % fällig am 25.08.2036 ^	503	455	0,00
5,410 % fällig am 25.08.2047	5.387	4.828	0,01
5,450 % fällig am 25.03.2037 ^	6.039	5.698	0,01
5,450 % fällig am 25.09.2047 ^	11.383	9.693	0,02
5,470 % fällig am 25.03.2037	13.694	7.512	0,01
5,480 % fällig am 25.08.2037 ^	12.232	10.375	0,02
5,510 % fällig am 25.01.2047	2.035	1.937	0,00

BESCHREIBUNG		PAR (000S)		MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
5,530 % fällig am 25.10.2036 ^	$	15.823	$	4.945	0,01
5,530 % fällig am 25.12.2036		1.951		696	0,00
5,530 % fällig am 25.02.2037 ^		2.396		2.063	0,00
5,530 % fällig am 25.08.2047		5.777		5.170	0,01
5,630 % fällig am 25.01.2047		2.695		2.457	0,01
5,710 % fällig am 25.08.2036		3.386		3.054	0,01
Deutsche ALT-A Securities, Inc. Mortgage Loan Trust					
3,238 % fällig am 25.08.2035 ^		622		553	0,00
3,910 % fällig am 25.02.2036 ^		367		262	0,00
4,042 % fällig am 25.10.2035		2.042		1.806	0,00
5,350 % fällig am 25.11.2035 ^		2		1	0,00
5,500 % fällig am 25.11.2035		783		749	0,00
5,500 % fällig am 25.12.2035 ^		645		522	0,00
Deutsche ALT-B Securities Mortgage Loan Trust					
6,005 % fällig am 25.10.2036 ^		1.316		1.063	0,00
6,445 % fällig am 25.02.2036 ^		3.773		3.288	0,01
Deutsche ALT-B Securities, Inc. Mortgage Loan Trust					
4,813 % fällig am 25.06.2036		251		213	0,00
4,813 % fällig am 25.06.2036 ^		1.889		1.642	0,00
Deutsche Mortgage & Asset Receiving Corp.					
6,500 % fällig am 27.07.2037		527		416	0,00
Deutsche Mortgage Securities, Inc. Mortgage Loan Trust					
6,125 % fällig am 25.06.2034		241		237	0,00
Deutsche Mortgage Securities, Inc. Re-REMIC Trust Certificates					
4,057 % fällig am 27.06.2037		510		453	0,00
Domi BV					
4,376 % fällig am 15.06.2051	€	5.523		6.029	0,01
Downey Savings & Loan Association Mortgage Loan Trust					
5,347 % fällig am 19.10.2036	$	6.164		5.112	0,01
5,357 % fällig am 19.10.2036		3.907		2.736	0,01
5,737 % fällig am 19.10.2045		3.216		2.751	0,01
5,897 % fällig am 19.10.2045		2.860		2.638	0,01
5,977 % fällig am 19.09.2044		7		6	0,00
Dragon Finance BV					
4,571 % fällig am 13.07.2023	£	1.299		1.651	0,00
Dutch Property Finance BV					
3,892 % fällig am 28.07.2054	€	11.868		12.915	0,02
4,168 % fällig am 28.04.2064		48.969		53.555	0,08
Eurohome UK Mortgages PLC					
5,137 % fällig am 15.06.2044	£	3.332		4.070	0,01
5,351 % fällig am 15.09.2044		5.250		6.322	0,01
5,601 % fällig am 15.09.2044		7.250		8.504	0,01
European Loan Conduit DAC					
4,358 % fällig am 17.02.2030	€	64.025		68.395	0,11
Eurosail PLC					
3,629 % fällig am 13.03.2045		37		40	0,00
3,709 % fällig am 13.03.2045		5.450		5.691	0,01
3,766 % fällig am 15.12.2044		732		787	0,00
3,936 % fällig am 10.09.2044		3.200		3.292	0,01
5,140 % fällig am 13.03.2045	£	1.362		1.711	0,00
5,150 % fällig am 13.03.2045		2		2	0,00
5,433 % fällig am 10.09.2044		1.200		1.442	0,00
5,760 % fällig am 13.09.2045		12.771		15.421	0,03
5,940 % fällig am 13.06.2045		11.883		14.911	0,02
5,989 % fällig am 13.06.2045		1.321		1.535	0,00
Finsbury Square PLC					
5,689 % fällig am 16.12.2071		4.206		5.321	0,01
First Horizon Alternative Mortgage Securities Trust					
4,203 % fällig am 25.09.2035 ^	$	156		129	0,00
4,386 % fällig am 25.03.2035		613		383	0,00
4,732 % fällig am 25.11.2035 ^		1.579		1.039	0,00
4,767 % fällig am 25.02.2037 ^		395		225	0,00
4,878 % fällig am 25.02.2036		112		84	0,00
5,118 % fällig am 25.01.2037 ^		797		594	0,00
5,139 % fällig am 25.11.2036 ^		820		592	0,00
5,500 % fällig am 25.11.2035		71		37	0,00
6,000 % fällig am 25.05.2036 ^		687		305	0,00
6,000 % fällig am 25.02.2037 ^		379		164	0,00
6,000 % fällig am 25.02.2037 ^		365		154	0,00
6,250 % fällig am 25.11.2036		2.082		696	0,00
First Horizon Mortgage Pass-Through Trust					
3,379 % fällig am 25.11.2036 ^		380		259	0,00
3,858 % fällig am 25.07.2037 ^		238		154	0,00
4,032 % fällig am 25.01.2036 ^		28		16	0,00
4,267 % fällig am 25.09.2035		5		5	0,00
4,283 % fällig am 25.11.2037 ^		458		398	0,00
4,900 % fällig am 25.08.2037 ^	$	239	$	80	0,00
6,000 % fällig am 25.05.2036		172		80	0,00
6,000 % fällig am 25.08.2037 ^		247		103	0,00

BESCHREIBUNG		PAR (000S)		MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
Fondo de Titulizacion de Activos UCI					
3,672 % fällig am 16.06.2049	€	10.745		11.044	0,02
FWD Securitization Trust					
2,240 % fällig am 25.01.2050	$	6.599		5.996	0,01
GC Pastor Hipotecario FTA					
3,721 % fällig am 21.06.2046	€	1.359		1.281	0,00
Glen Securities Finance DAC					
5,342 % fällig am 28.10.2038		3.538		3.806	0,01
6,342 % fällig am 28.10.2038		2.673		2.844	0,01
7,142 % fällig am 28.10.2038		1.277		1.361	0,00
Glenbeigh Issuer DAC					
4,350 % fällig am 24.06.2050		7.304		7.931	0,01
GMAC Commercial Mortgage Asset Corp.					
5,456 % fällig am 10.03.2051	$	18.169		16.582	0,03
5,550 % fällig am 10.08.2038		19.032		17.996	0,03
GMAC Mortgage Corp. Loan Trust					
3,281 % fällig am 19.04.2036 ^		302		236	0,00
3,351 % fällig am 19.11.2035 ^		59		50	0,00
3,742 % fällig am 18.03.2035		15		13	0,00
4,750 % fällig am 19.07.2035		148		127	0,00
Great Hall Mortgages PLC					
4,102 % fällig am 18.06.2039	€	800		784	0,00
4,772 % fällig am 18.06.2039		8.800		8.603	0,01
5,152 % fällig am 18.03.2039	£	3.074		3.875	0,01
5,166 % fällig am 18.06.2039		95		120	0,00
5,172 % fällig am 18.06.2038		2.005		2.529	0,01
5,644 % fällig am 18.06.2039	$	192		190	0,00
5,802 % fällig am 18.03.2039	£	1.710		1.952	0,00
6,277 % fällig am 18.06.2039		2.000		2.277	0,00
GreenPoint Mortgage Funding Trust					
5,550 % fällig am 25.10.2046	$	6.771		6.209	0,01
5,570 % fällig am 25.04.2036		295		253	0,00
5,590 % fällig am 25.06.2045		694		648	0,00
5,670 % fällig am 25.10.2045		3.327		3.262	0,01
5,730 % fällig am 25.02.2036		1.470		1.276	0,00
5,770 % fällig am 25.10.2045		2.447		2.228	0,00
Grifonas Finance PLC					
3,513 % fällig am 28.08.2039	€	18.519		19.242	0,03
GS Mortgage Securities Corp. Trust					
3,419 % fällig am 10.10.2032	$	91		89	0,00
4,744 % fällig am 10.10.2032		35.288		33.096	0,05
GS Mortgage Securities Corp. Trust					
6,990 % fällig am 15.07.2025		12.349		12.064	0,02
8,193 % fällig am 15.11.2032		19.350		18.476	0,03
GSC Capital Corp. Mortgage Trust					
5,550 % fällig am 25.02.2036 ^		1.670		1.514	0,00
GSMPS Mortgage Loan Trust					
3,731 % fällig am 25.06.2034		4.227		3.896	0,01
5,500 % fällig am 25.03.2035		6.094		5.331	0,01
5,500 % fällig am 25.09.2035		7.076		5.988	0,01
5,550 % fällig am 25.06.2034		1.356		1.193	0,00
7,059 % fällig am 20.10.2032		1.246		1.086	0,00
GSMSC Resecuritization Trust					
3,126 % fällig am 26.04.2037		9.344		2.596	0,01
4,310 % fällig am 26.08.2035		90		90	0,00
5,318 % fällig am 26.09.2036		8.104		5.388	0,01
GSR Mortgage Loan Trust					
3,575 % fällig am 25.03.2047 ^		5.635		3.679	0,01
3,704 % fällig am 25.05.2037 ^		1.304		752	0,00
3,733 % fällig am 25.04.2036 ^		3.713		2.553	0,01
3,845 % fällig am 25.05.2037		2.928		2.693	0,01
3,935 % fällig am 25.01.2036		839		821	0,00
4,310 % fällig am 25.05.2037 ^		122		104	0,00
4,660 % fällig am 25.07.2035		11		11	0,00
5,024 % fällig am 25.10.2035 ^		86		77	0,00
5,380 % fällig am 25.05.2037		12.202		6.259	0,01
5,500 % fällig am 25.06.2035		2.046		1.858	0,00
5,500 % fällig am 25.07.2035		494		445	0,00
5,590 % fällig am 25.08.2046		18.042		4.359	0,01
5,670 % fällig am 25.08.2046		15.076		3.959	0,01
5,750 % fällig am 25.03.2036 ^		228		203	0,00
5,750 % fällig am 25.05.2037 ^		139		301	0,00
6,000 % fällig am 25.02.2036		1.804		933	0,00
6,000 % fällig am 25.07.2036		1.880		1.117	0,00
6,000 % fällig am 25.07.2037 ^		459		299	0,00
6,250 % fällig am 25.08.2036		2.179		762	0,00
6,500 % fällig am 25.05.2036	$	937	$	321	0,00
6,970 % fällig am 25.05.2034		21		17	0,00

BESCHREIBUNG		PAR (000S)		MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
HarborView Mortgage Loan Trust					
3,827 % fällig am 19.06.2036 ^		2.180		1.190	0,00
4,061 % fällig am 19.11.2034		343		319	0,00
4,201 % fällig am 19.07.2035 ^		19		14	0,00
4,596 % fällig am 19.12.2035 ^		552		521	0,00
4,720 % fällig am 25.02.2036 ^		147		54	0,00
4,826 % fällig am 19.12.2036 ^		1.899		1.616	0,00
5,337 % fällig am 19.11.2036		16.874		14.945	0,02
5,337 % fällig am 19.11.2046 ^		881		649	0,00
5,347 % fällig am 19.09.2037		8.823		7.731	0,01
5,417 % fällig am 19.03.2037		4.773		4.293	0,01
5,457 % fällig am 25.01.2047		11.909		10.792	0,02
5,476 % fällig am 19.09.2035 ^		98		86	0,00
5,497 % fällig am 19.12.2036 ^		524		490	0,00
5,537 % fällig am 19.01.2038		9.667		8.952	0,02
5,567 % fällig am 19.12.2036		36.251		30.293	0,05
5,577 % fällig am 19.11.2036		13.602		11.854	0,02
5,597 % fällig am 19.05.2035		3.001		2.747	0,01
5,657 % fällig am 19.01.2036		3.195		1.980	0,00
5,697 % fällig am 19.03.2035		618		607	0,00
5,717 % fällig am 20.10.2045		3.845		2.468	0,01
5,746 % fällig am 19.04.2034		67		60	0,00
5,777 % fällig am 19.09.2035		8.655		4.663	0,01
5,777 % fällig am 19.11.2035		159		115	0,00
5,797 % fällig am 19.08.2045		2.470		1.913	0,00
5,837 % fällig am 19.01.2035		160		151	0,00
5,976 % fällig am 19.10.2035		6.639		3.861	0,01
5,976 % fällig am 19.01.2036 ^		957		407	0,00
6,150 % fällig am 25.10.2037		11.940		11.051	0,02
6,226 % fällig am 19.07.2045		19		16	0,00
6,507 % fällig am 20.06.2035		901		783	0,00
6,697 % fällig am 19.02.2036		1.853		1.002	0,00
Harbour					
5,358 % fällig am 28.01.2054	£	20.691		26.202	0,04
5,457 % fällig am 28.01.2054		14.500		18.183	0,03
Hilton Orlando Trust					
9,093 % fällig am 15.12.2034	$	2.213		2.128	0,00
Hipocat FTA					
3,351 % fällig am 24.10.2039	€	1.725		1.862	0,00
HomeBanc Mortgage Trust					
3,864 % fällig am 25.04.2037	$	538		483	0,00
4,203 % fällig am 25.04.2047		1.037		899	0,00
5,670 % fällig am 25.01.2036		561		534	0,00
5,885 % fällig am 25.01.2036		6.736		5.704	0,01
5,890 % fällig am 25.12.2034		59		55	0,00
Hops Hill PLC					
5,854 % fällig am 27.05.2054	£	25.818		32.867	0,05
HSI Asset Loan Obligation Trust					
1,480 % fällig am 25.12.2036 (a)	$	1.493		145	0,00
5,520 % fällig am 25.12.2036		1.915		385	0,00
Impac CMB Trust					
5,690 % fällig am 25.05.2035		176		163	0,00
5,780 % fällig am 25.02.2036		1.520		1.217	0,00
5,790 % fällig am 25.11.2034		1.173		1.134	0,00
5,790 % fällig am 25.03.2035		2.560		2.346	0,00
5,830 % fällig am 25.01.2035		1.998		1.868	0,00
6,060 % fällig am 25.10.2034		335		327	0,00
Impac Secured Assets CMN Owner Trust					
5,450 % fällig am 25.03.2033		220		210	0,00
Impac Secured Assets Corp.					
5,790 % fällig am 25.03.2036		1.289		1.029	0,00
6,575 % fällig am 25.02.2035		335		336	0,00
Impac Secured Assets Trust					
5,370 % fällig am 25.05.2037 ^		560		440	0,00
5,550 % fällig am 25.11.2036		526		521	0,00
5,630 % fällig am 25.03.2037		4.554		3.747	0,01
5,630 % fällig am 25.09.2037 ^		2.763		2.295	0,00
5,670 % fällig am 25.01.2037		8.753		7.008	0,01
5,690 % fällig am 25.11.2036		6.342		4.864	0,01
5,690 % fällig am 25.02.2037 ^		4.971		4.423	0,01
5,850 % fällig am 25.05.2036		399		341	0,00
5,870 % fällig am 25.09.2037		2.357		1.929	0,00
IndyMac Adjustable Rate Mortgage Trust					
3,686 % fällig am 25.01.2032		1		1	0,00
IndyMac Mortgage Loan Trust					
3,098 % fällig am 25.09.2035 ^		45		38	0,00
3,102 % fällig am 25.06.2037 ^		1.741		1.576	0,00
3,103 % fällig am 25.06.2037 ^		3.026		2.474	0,01

BESCHREIBUNG		PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
3,233 % fällig am 25.08.2037 ^	$	4.695	$ 3.592	0,01
3,261 % fällig am 25.06.2036		5.568	3.690	0,01
3,314 % fällig am 25.07.2037		6.867	5.975	0,01
3,317 % fällig am 25.05.2037 ^		1.561	1.285	0,00
3,335 % fällig am 25.04.2037		3.641	3.012	0,01
3,385 % fällig am 25.05.2035 ^		226	180	0,00
3,438 % fällig am 25.03.2036 ^		3.449	2.442	0,01
3,442 % fällig am 25.08.2037		2.781	1.894	0,00
3,446 % fällig am 25.08.2036		158	124	0,00
3,457 % fällig am 25.04.2037		6.836	5.776	0,01
3,482 % fällig am 25.08.2035		63	47	0,00
3,534 % fällig am 25.11.2035 ^		35	24	0,00
3,549 % fällig am 25.03.2037 ^		16	13	0,00
3,558 % fällig am 25.05.2037 ^		2.025	1.377	0,00
3,561 % fällig am 25.09.2036		1.413	966	0,00
3,570 % fällig am 25.09.2036 ^		104	88	0,00
3,641 % fällig am 25.05.2036 ^		155	136	0,00
3,651 % fällig am 25.01.2037 ^		159	128	0,00
3,688 % fällig am 25.09.2035 ^		292	197	0,00
3,695 % fällig am 25.07.2036		3.383	2.408	0,00
3,699 % fällig am 25.12.2035		3.421	2.596	0,01
3,747 % fällig am 25.06.2037 ^		6.312	4.383	0,01
3,778 % fällig am 25.11.2035 ^		1.444	1.163	0,00
3,789 % fällig am 25.09.2036 ^		126	106	0,00
3,860 % fällig am 25.05.2035 ^		58	42	0,00
3,987 % fällig am 25.09.2037		12.865	9.737	0,02
4,335 % fällig am 25.08.2034		79	71	0,00
5,310 % fällig am 25.04.2037		944	820	0,00
5,340 % fällig am 25.04.2037		1.588	1.381	0,00
5,390 % fällig am 25.07.2036		4.540	4.281	0,01
5,400 % fällig am 25.09.2037		4.245	3.911	0,01
5,410 % fällig am 25.10.2036		2.545	2.184	0,00
5,490 % fällig am 25.01.2037 ^		7.984	6.721	0,01
5,500 % fällig am 25.06.2036		2.769	2.161	0,00
5,510 % fällig am 25.08.2036		8.134	5.828	0,01
5,510 % fällig am 25.02.2037 ^		5.732	5.102	0,01
5,510 % fällig am 25.07.2047		3.364	2.341	0,00
5,530 % fällig am 25.10.2036		5.079	2.153	0,00
5,550 % fällig am 25.06.2046		5.667	4.534	0,01
5,550 % fällig am 25.11.2046		6.400	5.776	0,01
5,570 % fällig am 25.11.2036		155	144	0,00
5,570 % fällig am 25.02.2046		5.027	3.740	0,01
5,570 % fällig am 25.04.2046		2.654	2.386	0,00
5,570 % fällig am 25.05.2046		7.592	6.753	0,01
5,590 % fällig am 25.04.2046		382	344	0,00
5,610 % fällig am 25.04.2035		271	237	0,00
5,650 % fällig am 25.11.2036		3.671	3.590	0,01
5,670 % fällig am 25.07.2035		5.781	4.102	0,01
5,690 % fällig am 25.10.2036		2.069	885	0,00
5,730 % fällig am 25.01.2036		3.007	2.055	0,00
5,750 % fällig am 25.07.2035		1.092	889	0,00
5,930 % fällig am 25.12.2034		780	618	0,00
5,950 % fällig am 25.07.2046		4.658	4.090	0,01
5,970 % fällig am 25.11.2034 ^		1.011	872	0,00
6,000 % fällig am 25.07.2037 ^		680	501	0,00
6,000 % fällig am 25.08.2037 ^		195	81	0,00
6,000 % fällig am 25.08.2037		782	333	0,00
6,010 % fällig am 25.09.2034		44	37	0,00
6,500 % fällig am 25.07.2037 ^		370	123	0,00
6,500 % fällig am 25.09.2037 ^		1.783	1.086	0,00
6,500 % fällig am 25.10.2037		2.701	1.489	0,00
JPMorgan Alternative Loan Trust				
3,357 % fällig am 25.10.2036		4.369	3.713	0,01
3,841 % fällig am 25.03.2036		681	510	0,00
3,881 % fällig am 25.01.2036		365	240	0,00
3,941 % fällig am 25.03.2037 ^		958	869	0,00
5,470 % fällig am 25.07.2036		2.677	2.368	0,00
5,510 % fällig am 25.05.2036		2.832	2.411	0,00
5,710 % fällig am 25.06.2037		17.935	7.461	0,01
5,710 % fällig am 25.04.2047		3.308	3.114	0,01
5,843 % fällig am 26.05.2037		2.729	2.062	0,00
6,000 % fällig am 27.12.2036		1.114	617	0,00
6,180 % fällig am 25.03.2036		6.851	5.855	0,01
6,210 % fällig am 25.12.2036 ^		141	132	0,00
6,460 % fällig am 25.12.2036 ^		967	920	0,00
6,550 % fällig am 25.05.2036		102	99	0,00
6,620 % fällig am 25.08.2036 ^		186	172	0,00
6,920 % fällig am 25.08.2036 ^		3.811	2.952	0,01
JPMorgan Chase Commercial Mortgage Securities Corp.				
6,243 % fällig am 15.02.2035		31.050	30.604	0,05
JPMorgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust				
1,091 % fällig am 15.04.2046				
(a)		1.449	0	0,00
2,949 % fällig am 06.09.2038		11.700	10.289	0,02
4,128 % fällig am 05.07.2031	$	28.120	$ 25.676	0,04

BESCHREIBUNG		PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
4,549 % fällig am 05.07.2033		3.809	3.364	0,01
4,950 % fällig am 05.07.2033		38.900	33.614	0,05
5,337 % fällig am 15.05.2047		1.105	1.034	0,00
5,350 % fällig am 05.07.2033		9.940	8.401	0,01
6,293 % fällig am 15.12.2036		17.100	15.017	0,02
6,743 % fällig am 15.02.2035		2.184	2.104	0,00
7,063 % fällig am 05.07.2033		10.109	9.028	0,02
JPMorgan Mortgage Trust				
3,655 % fällig am 27.07.2037		456	412	0,00
3,853 % fällig am 25.05.2036 ^		40	34	0,00
3,859 % fällig am 25.04.2037 ^		3	2	0,00
3,881 % fällig am 25.01.2037 ^		1.336	1.082	0,00
3,904 % fällig am 25.10.2036		201	145	0,00
3,909 % fällig am 25.11.2035 ^		760	662	0,00
3,909 % fällig am 25.11.2035		2.511	2.185	0,00
3,912 % fällig am 25.08.2035 ^		186	157	0,00
3,912 % fällig am 25.08.2036		102	75	0,00
3,921 % fällig am 25.11.2035 ^		1.760	1.445	0,00
3,927 % fällig am 25.05.2036		1.337	1.103	0,00
3,937 % fällig am 25.08.2035		613	609	0,00
3,942 % fällig am 25.05.2036		2.724	2.313	0,00
3,954 % fällig am 25.05.2037 ^		382	333	0,00
4,035 % fällig am 25.04.2036 ^		2.914	2.518	0,01
4,106 % fällig am 25.09.2035		353	322	0,00
4,176 % fällig am 25.04.2035 ^		306	277	0,00
4,177 % fällig am 25.08.2036		3.634	3.058	0,01
4,197 % fällig am 25.05.2037		1.418	1.246	0,00
4,274 % fällig am 25.06.2034		14	13	0,00
4,288 % fällig am 25.10.2037		2.429	1.915	0,00
4,700 % fällig am 25.07.2035		271	241	0,00
5,500 % fällig am 25.07.2036		2.913	1.574	0,00
5,750 % fällig am 25.01.2036 ^		981	485	0,00
6,000 % fällig am 25.08.2037		2.646	1.437	0,00
6,000 % fällig am 25.08.2037 ^		4.858	2.639	0,01
6,250 % fällig am 25.08.2037		5.086	1.593	0,00
6,500 % fällig am 25.01.2035		1.363	1.363	0,00
6,500 % fällig am 25.07.2036 ^		219	89	0,00
6,500 % fällig am 25.08.2036		4.390	1.589	0,00
JPMorgan Resecuritization Trust				
4,500 % fällig am 26.04.2037		1.389	679	0,00
4,716 % fällig am 26.09.2036		259	225	0,00
5,428 % fällig am 26.09.2037		1.292	969	0,00
5,750 % fällig am 26.05.2037		127	57	0,00
6,000 % fällig am 26.09.2036		515	398	0,00
Jupiter Mortgage PLC				
5,891 % fällig am 20.07.2060	£	5.900	7.480	0,01
Kinbane DAC				
4,263 % fällig am 25.09.2062	€	42.653	46.173	0,07
Kirkby RMBS PLC				
0,000 % fällig am 22.02.2045	£	1	2.645	0,01
2,250 % fällig am 22.02.2045		4.258	1.085	0,00
5,668 % fällig am 22.02.2045		27.490	33.693	0,05
6,868 % fällig am 22.02.2045		13.150	15.441	0,03
Landmark Mortgage Securities PLC				
3,767 % fällig am 17.06.2038	€	12	13	0,00
5,222 % fällig am 17.06.2039	£	5.590	6.838	0,01
5,242 % fällig am 17.06.2038		21	27	0,00
Lanebrook Mortgage Transaction PLC				
5,965 % fällig am 12.06.2057		15.511	19.750	0,03
Lansdowne Mortgage Securities PLC				
3,826 % fällig am 15.06.2045	€	3.155	3.234	0,01
Legacy Mortgage Asset Trust				
0,000 % fällig am 25.12.2056				
(a)	$	117.856	835	0,00
0,125 % fällig am 26.12.2057				
(a)		69.561	333	0,00
1,323 % fällig am 26.12.2057				
(a)		20.396	230	0,00
3,017 % fällig am 25.12.2056		117.271	94.696	0,15
4,000 % fällig am 25.02.2058		2.226	2.181	0,00
4,000 % fällig am 26.08.2058		11.467	11.355	0,02
4,218 % fällig am 25.02.2058		1.575	1.052	0,00
4,240 % fällig am 25.01.2058		21.926	19.132	0,03
4,250 % fällig am 25.02.2058		1.575	1.488	0,00
4,250 % fällig am 26.08.2058		35.727	33.638	0,05
4,280 % fällig am 26.08.2058		17.864	12.480	0,02
4,500 % fällig am 25.02.2058		1.575	1.436	0,00
4,573 % fällig am 26.12.2057		48.440	36.842	0,06
Lehman Mortgage Trust				
5,650 % fällig am 25.07.2037 ^		428	349	0,00
5,750 % fällig am 25.01.2037		302	181	0,00
6,000 % fällig am 25.01.2036		2.406	561	0,00
6,000 % fällig am 25.07.2036		668	340	0,00

BESCHREIBUNG		PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
6,000 % fällig am 25.12.2036	$	1.124	$ 939	0,00
6,050 % fällig am 25.12.2035 ^		592	359	0,00
Lehman XS Trust				
4,976 % fällig am 25.11.2035		94	90	0,00
5,390 % fällig am 25.08.2036 ^		52	52	0,00
5,420 % fällig am 25.02.2036		314	281	0,00
5,450 % fällig am 25.11.2035		4.318	4.235	0,01
5,476 % fällig am 25.03.2047		2.909	2.739	0,01
5,530 % fällig am 25.12.2036		5.441	4.293	0,01
5,530 % fällig am 25.09.2046		121	103	0,00
5,550 % fällig am 25.08.2046		4.235	3.886	0,01
5,550 % fällig am 25.11.2046 ^		768	705	0,00
5,550 % fällig am 25.03.2047		14.531	12.439	0,02
5,550 % fällig am 25.06.2047 ^		5.683	4.728	0,01
5,560 % fällig am 25.08.2046		8.175	7.431	0,01
5,570 % fällig am 25.11.2046		13.337	11.644	0,02
5,590 % fällig am 25.06.2047		5.746	5.187	0,01
5,650 % fällig am 25.08.2037		2.870	2.620	0,01
5,670 % fällig am 25.02.2046 ^		8.731	7.737	0,01
6,050 % fällig am 25.08.2047 ^		10.055	8.434	0,01
6,850 % fällig am 25.09.2047		1.464	1.266	0,00
London Wall Mortgage Capital PLC				
5,502 % fällig am 15.05.2052	£	9.139	11.528	0,02
Ludgate Funding PLC				
3,212 % fällig am 01.01.2061	€	2.894	3.018	0,01
3,292 % fällig am 01.01.2061		792	795	0,00
3,362 % fällig am 01.01.2061		2.639	2.629	0,01
3,752 % fällig am 01.01.2061		10.687	11.141	0,02
3,764 % fällig am 01.12.2060		1.658	1.664	0,00
4,670 % fällig am 01.01.2061	£	5.806	6.819	0,01
5,030 % fällig am 01.01.2061		3.653	4.446	0,01
5,068 % fällig am 01.12.2060		961	1.161	0,00
5,178 % fällig am 01.12.2060		2.163	2.540	0,01
Luminent Mortgage Trust				
5,430 % fällig am 25.01.2037 ^	$	2.367	1.995	0,00
5,490 % fällig am 25.12.2036		2.884	2.550	0,01
5,510 % fällig am 25.12.2036 ^		95	86	0,00
5,530 % fällig am 25.05.2046		876	733	0,00
5,550 % fällig am 25.02.2046		1.757	1.338	0,00
Madison Avenue Mortgage Trust				
3,294 % fällig am 15.08.2034		8.074	7.430	0,01
Mansard Mortgages PLC				
4,765 % fällig am 15.04.2047	£	1.980	2.423	0,01
6,251 % fällig am 15.12.2049		3.273	3.971	0,01
7,001 % fällig am 15.12.2049		2.909	3.614	0,01
MASTR Adjustable Rate Mortgages Trust				
3,234 % fällig am 25.02.2035	$	159	132	0,00
3,352 % fällig am 25.03.2035		479	408	0,00
3,515 % fällig am 25.03.2035		100	89	0,00
3,904 % fällig am 25.03.2035		51	39	0,00
4,267 % fällig am 25.09.2034		818	724	0,00
6,250 % fällig am 25.09.2037		7.382	3.208	0,01
7,480 % fällig am 25.12.2035		805	789	0,00
MASTR Alternative Loan Trust				
5,500 % fällig am 25.04.2035		2.290	2.125	0,00
5,750 % fällig am 25.08.2035 ^		1.341	727	0,00
6,500 % fällig am 25.05.2034		64	61	0,00
MASTR Asset Securitization Trust				
5,000 % fällig am 25.07.2019		0	0	0,00
6,000 % fällig am 25.06.2036 ^		164	107	0,00
6,000 % fällig am 25.06.2036 ^		1.600	1.066	0,00
6,000 % fällig am 25.10.2036		661	581	0,00
MASTR Reperforming Loan Trust				
5,510 % fällig am 25.07.2035 ^		3.009	1.467	0,00
7,000 % fällig am 25.08.2034		10	7	0,00
MASTR Seasoned Securitization Trust				
5,550 % fällig am 25.10.2032		139	123	0,00
Mellon Residential Funding Corp. Mortgage Pass-Through Trust				
5,673 % fällig am 15.06.2030		4	3	0,00
Merrill Lynch Alternative Note Asset Trust				
4,011 % fällig am 25.06.2037 ^		2.551	1.478	0,00
5,570 % fällig am 25.04.2037		11.913	2.430	0,00
Merrill Lynch Mortgage Investors Trust				
0,182 % fällig am 25.01.2029				
(a)		542	2	0,00
4,128 % fällig am 25.01.2037		35	33	0,00
4,238 % fällig am 25.01.2037		0	0	0,00
4,324 % fällig am 25.12.2034		136	129	0,00
4,359 % fällig am 25.11.2035		82	76	0,00
4,459 % fällig am 25.05.2036		3	3	0,00

BESCHREIBUNG		PAR (000S)		MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
4,674 % fällig am 25.12.2035	$	24	$	22	0,00
4,674 % fällig am 25.12.2035		1.909		1.821	0,00
5,610 % fällig am 25.04.2029		425		393	0,00
5,810 % fällig am 25.06.2028		0		0	0,00
5,810 % fällig am 25.09.2029		13		12	0,00
5,870 % fällig am 25.08.2035		2.952		2.732	0,01
5,975 % fällig am 25.11.2029		666		580	0,00
5,997 % fällig am 25.09.2029		105		97	0,00
6,095 % fällig am 25.08.2036		1.810		1.611	0,00
Merrill Lynch Mortgage-Backed Securities Trust					
7,620 % fällig am 25.08.2036 ^		1.605		1.422	0,00
Metlife Securitization Trust					
3,750 % fällig am 25.03.2057		5.018		4.702	0,01
Miravet SARL					
4,265 % fällig am 26.05.2065	€	34.623		37.192	0,06
Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust					
1,063 % fällig am 15.02.2047 (a)	$	3.767		5	0,00
3,046 % fällig am 15.04.2048		40.000		38.013	0,06
Morgan Stanley Capital Trust					
7,143 % fällig am 15.07.2035		34.709		33.910	0,05
Morgan Stanley Mortgage Loan Trust					
2,120 % fällig am 25.06.2037		3.848		2.022	0,00
3,103 % fällig am 25.11.2037		6.533		4.327	0,01
3,108 % fällig am 25.11.2037 ^		91		59	0,00
4,148 % fällig am 25.03.2036 ^		39		25	0,00
4,183 % fällig am 25.10.2037		661		451	0,00
4,271 % fällig am 25.05.2036 ^		1.728		1.015	0,00
4,614 % fällig am 25.08.2034		25		23	0,00
5,470 % fällig am 25.06.2036		3.592		757	0,00
5,490 % fällig am 25.08.2036		5.913		1.772	0,00
5,500 % fällig am 25.10.2037 ^		312		288	0,00
5,660 % fällig am 25.02.2047		7.306		3.065	0,01
5,750 % fällig am 25.02.2036 ^		468		410	0,00
6,000 % fällig am 25.12.2035		2.598		1.081	0,00
6,000 % fällig am 25.08.2036 ^		2.305		1.585	0,00
6,000 % fällig am 25.08.2036		1.211		567	0,00
6,000 % fällig am 25.10.2037 ^		2.943		1.774	0,00
6,000 % fällig am 25.10.2037		7.806		4.235	0,01
6,115 % fällig am 25.06.2036		1.086		1.068	0,00
6,275 % fällig am 25.09.2035		2.124		2.045	0,00
6,354 % fällig am 25.08.2036 ^		1.277		255	0,00
6,500 % fällig am 25.02.2036 ^		100		46	0,00
6,875 % fällig am 25.11.2035		1.855		1.765	0,00
7,130 % fällig am 25.09.2035		1.029		990	0,00
Morgan Stanley Re-REMIC Trust					
3,768 % fällig am 26.12.2036		2.461		2.120	0,00
Morgan Stanley Resecuritization Trust					
3,644 % fällig am 26.06.2047		5.669		4.484	0,01
3,693 % fällig am 26.11.2046		3.074		2.628	0,01
Mortgage Equity Conversion Asset Trust					
5,720 % fällig am 25.02.2042		5.896		5.694	0,01
Mortgage Funding PLC					
6,090 % fällig am 13.03.2046	£	7.619		9.619	0,02
MortgageIT Securities Corp. Mortgage Loan Trust					
5,610 % fällig am 25.06.2047	$	8.151		6.629	0,01
5,650 % fällig am 25.09.2037		3.379		2.932	0,01
MortgageIT Trust					
5,710 % fällig am 25.10.2035		138		135	0,00
5,750 % fällig am 25.08.2035		1.653		1.573	0,00
5,770 % fällig am 25.12.2035		1.614		1.536	0,00
6,035 % fällig am 25.02.2035		350		328	0,00
6,420 % fällig am 25.02.2035		2		2	0,00
MSDB Trust					
3,427 % fällig am 11.07.2039		1.600		1.364	0,00
MSSG Trust					
3,397 % fällig am 13.09.2039		9.550		8.071	0,01
New Century Alternative Mortgage Loan Trust					
4,654 % fällig am 25.10.2036 ^		6.260		1.292	0,00
6,810 % fällig am 25.07.2036		3.271		783	0,00
New Century Home Equity Loan Trust					
3,750 % fällig am 25.08.2055		4.779		4.425	0,01
New Residential Mortgage Loan Trust					
4,500 % fällig am 25.05.2058		16.288		15.555	0,03
Newgate Funding PLC					
3,420 % fällig am 01.12.2050	€	4.664		4.852	0,01
3,694 % fällig am 01.12.2050		1.349		1.311	0,00
4,126 % fällig am 15.12.2050		10.139		10.665	0,02
4,880 % fällig am 01.12.2050	£	3.451		4.184	0,01
5,038 % fällig am 01.12.2050		26.053		31.323	0,05
5,165 % fällig am 15.12.2050	£	9.190	$	11.034	0,02
6,005 % fällig am 15.12.2050		2.640		3.221	0,01
6,255 % fällig am 15.12.2050		421		493	0,00

BESCHREIBUNG		PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
Nomura Asset Acceptance Corp. Alternative Loan Trust				
4,680 % fällig am 25.06.2036	$	272	206	0,00
5,034 % fällig am 25.05.2035		1.587	812	0,00
5,400 % fällig am 25.06.2037		613	530	0,00
5,669 % fällig am 25.03.2047		821	731	0,00
5,670 % fällig am 25.12.2035		775	217	0,00
5,688 % fällig am 25.07.2035		461	441	0,00
5,995 % fällig am 25.03.2047		1.510	1.344	0,00
6,150 % fällig am 25.05.2035		1.292	1.044	0,00
6,170 % fällig am 25.08.2034		349	324	0,00
6,408 % fällig am 25.05.2036 ^		732	165	0,00
6,772 % fällig am 25.02.2036 ^		35	30	0,00
Nomura Resecuritization Trust				
1,893 % fällig am 26.03.2037		2.382	1.946	0,00
6,050 % fällig am 25.07.2036		21.897	20.752	0,03
NovaStar Mortgage Funding Trust				
0,440 % fällig am 25.09.2046		11.514	4.030	0,01
OBX Trust				
5,800 % fällig am 25.06.2057		1.853	1.758	0,00
6,000 % fällig am 25.04.2048		482	478	0,00
Paragon Mortgages PLC				
5,752 % fällig am 15.05.2045	£	5.383	6.848	0,01
Pepper Residential Securities Trust				
6,057 % fällig am 18.11.2060	$	1.886	1.885	0,00
PHH Alternative Mortgage Trust				
5,470 % fällig am 25.02.2037		4.170	3.137	0,01
5,630 % fällig am 25.05.2037		2.025	1.859	0,00
5,850 % fällig am 25.07.2037		902	864	0,00
Pierpont BTL PLC				
0,000 % fällig am 21.09.2054	£	9.850	12.493	0,02
Polaris PLC				
5,631 % fällig am 23.12.2058		3.631	4.595	0,01
6,154 % fällig am 27.05.2057		13.782	17.537	0,03
7,490 % fällig am 23.05.2059		2.768	3.544	0,01
Precise Mortgage Funding PLC				
0,000 % fällig am 12.12.2055 (f)		0	6.776	0,01
5,657 % fällig am 16.10.2056		10.057	12.769	0,02
6,004 % fällig am 12.03.2055		3.983	5.069	0,01
6,177 % fällig am 16.10.2056		1.200	1.517	0,00
6,427 % fällig am 16.10.2056		1.000	1.261	0,00
6,677 % fällig am 16.10.2056		1.000	1.246	0,00
7,827 % fällig am 16.10.2056		1.000	1.234	0,00
Prime Mortgage Trust				
6,000 % fällig am 25.06.2036 ^	$	9	9	0,00
Primrose Residential DAC				
4,189 % fällig am 24.03.2061	€	3.845	4.167	0,01
4,439 % fällig am 24.10.2061		30.249	32.690	0,05
Proteus RMBS DAC				
0,000 % fällig am 29.10.2054 (b)(f)		13.990	12.417	0,02
0,000 % fällig am 29.10.2054		200	0	0,00
4,150 % fällig am 29.10.2054		47.658	52.344	0,08
4,600 % fällig am 29.10.2054		8.681	9.443	0,02
4,900 % fällig am 29.10.2054		6.313	6.867	0,01
5,880 % fällig am 29.10.2054		4.735	5.181	0,01
7,750 % fällig am 29.10.2054		3.946	4.335	0,01
RBSGC Mortgage Loan Trust				
5,600 % fällig am 25.01.2037 ^	$	530	175	0,00
RBSGC Structured Trust				
5,500 % fällig am 25.11.2035 ^		65	54	0,00
RBSSP Resecuritization Trust				
3,514 % fällig am 26.01.2036		5.097	4.550	0,01
3,768 % fällig am 26.12.2036		3.143	2.966	0,01
5,378 % fällig am 27.06.2036		2.100	1.662	0,00
6,000 % fällig am 26.05.2036		1.499	666	0,00
6,000 % fällig am 26.08.2037		567	472	0,00
12,418 % fällig am 26.10.2037		2.098	1.816	0,00
Residential Accredit Loans, Inc. Trust				
1,400 % fällig am 25.12.2036 (a)		1.930	206	0,00
1,490 % fällig am 25.01.2037 (a)		1.919	185	0,00
1,500 % fällig am 25.12.2036 (a)		773	62	0,00
2,050 % fällig am 25.12.2036 (a)		1.171	156	0,00
4,041 % fällig am 25.08.2035 ^		117	98	0,00
4,073 % fällig am 25.02.2035 ^		447	363	0,00
4,398 % fällig am 25.10.2037		4.761	4.226	0,01
4,597 % fällig am 25.02.2035 ^		423	212	0,00
4,873 % fällig am 25.07.2035 ^		876	812	0,00

BESCHREIBUNG		PAR (000S)		MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
5,091 % fällig am 25.11.2037	$	446	$	372	0,00
5,336 % fällig am 25.09.2045		428		384	0,00
5,350 % fällig am 25.05.2037		100		88	0,00
5,400 % fällig am 25.03.2037 ^		2.069		1.472	0,00
5,450 % fällig am 25.08.2035		145		110	0,00
5,450 % fällig am 25.12.2036		3.574		2.360	0,00
5,450 % fällig am 25.06.2037 ^		1.020		907	0,00
5,450 % fällig am 25.02.2047		1.474		1.296	0,00
5,470 % fällig am 25.01.2037		4.671		4.045	0,01
5,476 % fällig am 25.08.2035		1.594		1.316	0,00
5,490 % fällig am 25.12.2036		2.347		2.242	0,00
5,490 % fällig am 25.01.2037		1.946		1.604	0,00
5,500 % fällig am 25.06.2035 ^		911		750	0,00
5,500 % fällig am 25.09.2035 ^		1.395		1.135	0,00
5,500 % fällig am 25.02.2036		571		453	0,00
5,500 % fällig am 25.12.2036		2.059		1.432	0,00
5,510 % fällig am 25.07.2036		985		853	0,00
5,510 % fällig am 25.07.2036 ^		5.771		2.418	0,00
5,510 % fällig am 25.01.2037 ^		1.909		1.271	0,00
5,530 % fällig am 25.07.2036		1.282		1.112	0,00
5,530 % fällig am 25.09.2036 ^		1.765		1.631	0,00
5,530 % fällig am 25.12.2036		1.423		1.245	0,00
5,530 % fällig am 25.07.2037		4.123		3.788	0,01
5,530 % fällig am 25.05.2047		923		821	0,00
5,550 % fällig am 25.08.2036 ^		146		108	0,00
5,550 % fällig am 25.05.2037 ^		3.019		2.132	0,00
5,580 % fällig am 25.05.2046		2.997		2.602	0,01
5,690 % fällig am 25.02.2046 ^		72		46	0,00
5,690 % fällig am 25.05.2046 ^		2.701		2.156	0,00
5,750 % fällig am 25.04.2036		2.013		1.709	0,00
5,750 % fällig am 25.01.2037		1.531		1.154	0,00
5,750 % fällig am 25.03.2037 ^		4.563		3.401	0,01
6,000 % fällig am 25.09.2035 ^		2.092		1.824	0,00
6,000 % fällig am 25.12.2035		966		869	0,00
6,000 % fällig am 25.04.2036		1.013		816	0,00
6,000 % fällig am 25.05.2036 ^		464		362	0,00
6,000 % fällig am 25.06.2036 ^		2.423		1.933	0,00
6,000 % fällig am 25.06.2036 ^		214		166	0,00
6,000 % fällig am 25.07.2036 ^		278		213	0,00
6,000 % fällig am 25.08.2036 ^		125		100	0,00
6,000 % fällig am 25.08.2036 ^		4.948		4.039	0,01
6,000 % fällig am 25.09.2036 ^		882		666	0,00
6,000 % fällig am 25.11.2036 ^		183		143	0,00
6,000 % fällig am 25.01.2037		435		333	0,00
6,000 % fällig am 25.01.2037 ^		3.422		2.649	0,01
6,000 % fällig am 25.03.2037 ^		415		342	0,00
6,000 % fällig am 25.04.2037 ^		352		274	0,00
6,000 % fällig am 25.05.2037 ^		309		250	0,00
6,000 % fällig am 25.06.2037 ^		443		345	0,00
6,109 % fällig am 25.02.2036 ^		1.906		1.540	0,00
6,250 % fällig am 25.01.2037 ^		113		92	0,00
6,250 % fällig am 25.02.2037 ^		2.769		2.264	0,00
6,500 % fällig am 25.09.2036 ^		480		242	0,00
6,500 % fällig am 25.11.2036 ^		234		186	0,00
6,500 % fällig am 25.02.2037		4.729		3.928	0,01
6,750 % fällig am 25.06.2037		896		374	0,00
Residential Asset Securitization Trust					
5,500 % fällig am 25.08.2034		820		788	0,00
5,500 % fällig am 25.09.2035		2.630		1.355	0,00
5,500 % fällig am 25.11.2035 ^		117		57	0,00
5,750 % fällig am 25.02.2036		1.314		1.213	0,00
6,000 % fällig am 25.07.2035 ^		1.356		928	0,00
6,000 % fällig am 25.02.2036		17.182		7.777	0,01
6,000 % fällig am 25.04.2036 ^		430		190	0,00
6,000 % fällig am 25.04.2036 ^		2.456		1.203	0,00
6,000 % fällig am 25.06.2036		3.965		1.733	0,00
6,000 % fällig am 25.09.2036 ^		7.160		2.373	0,00
6,000 % fällig am 25.12.2036 ^		9.900		3.146	0,01
6,000 % fällig am 25.04.2037 ^		587		342	0,00
6,000 % fällig am 25.04.2037 ^		500		284	0,00
6,000 % fällig am 25.07.2037 ^		1.077		467	0,00
6,000 % fällig am 25.08.2037		2.324		1.328	0,00
6,000 % fällig am 25.01.2046		1.504		650	0,00
6,000 % fällig am 25.01.2046 ^		870		378	0,00
6,250 % fällig am 25.08.2036		1.234		856	0,00
6,250 % fällig am 25.12.2036 ^		2.011		751	0,00
6,500 % fällig am 25.07.2036		1.076		333	0,00
6,500 % fällig am 25.09.2036 ^		1.219		436	0,00
6,500 % fällig am 25.04.2037 ^		9.874		2.855	0,01
6,500 % fällig am 25.06.2037		6.838		1.682	0,00
6,609 % fällig am 25.02.2037		11.721		2.899	0,01
Residential Funding Mortgage Securities, Inc. Trust					
3,707 % fällig am 25.08.2035 ^		41		20	0,00

BESCHREIBUNG		PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
3,860 % fällig am 25.06.2035	$	251	$ 143	0,00
4,112 % fällig am 25.04.2037		145	84	0,00
4,115 % fällig am 25.09.2036 ^		89	46	0,00
4,149 % fällig am 25.09.2035 ^		2.159	1.397	0,00
4,500 % fällig am 25.10.2018		13	5	0,00
4,573 % fällig am 25.04.2037		87	69	0,00
4,573 % fällig am 25.04.2037 ^		340	263	0,00
4,978 % fällig am 27.07.2037 ^		399	329	0,00
5,224 % fällig am 25.08.2036 ^		1.150	807	0,00
6,000 % fällig am 25.06.2036 ^		263	219	0,00
6,000 % fällig am 25.07.2036 ^		190	158	0,00
6,000 % fällig am 25.09.2036		758	569	0,00
6,250 % fällig am 25.08.2036		1.269	1.056	0,00
Residential Mortgage Securities PLC				
6,159 % fällig am 20.06.2070	£	10.820	13.799	0,02
6,809 % fällig am 20.06.2070		1.355	1.723	0,00
RESIMAC Bastille Trust				
5,190 % fällig am 05.09.2057	AUD	11.771	7.835	0,01
RESIMAC Premier				
5,350 % fällig am 07.02.2052		5.758	3.836	0,01
6,241 % fällig am 07.02.2052	$	1.675	1.674	0,00
Resloc UK PLC				
5,221 % fällig am 15.12.2043	£	2.380	2.851	0,01
5,250 % fällig am 15.12.2043	$	11.861	11.209	0,02
Ripon Mortgages PLC				
5,491 % fällig am 28.08.2056	£	466.608	591.116	0,92
River Green Finance DAC				
3,911 % fällig am 22.01.2032	€	13.255	13.926	0,02
RiverView HECM Trust				
5,420 % fällig am 25.05.2047	$	4.329	4.116	0,01
RMAC Securities PLC				
3,636 % fällig am 12.06.2044	€	1.850	1.938	0,00
3,726 % fällig am 12.06.2044		5.884	6.021	0,01
3,756 % fällig am 12.06.2044		1.736	1.770	0,00
3,956 % fällig am 12.06.2044		5.852	5.945	0,01
5,134 % fällig am 12.06.2044	£	1.652	2.015	0,00
5,154 % fällig am 12.06.2044		21.728	26.432	0,04
5,414 % fällig am 12.06.2044		753	901	0,00
5,502 % fällig am 12.06.2044	$	292	280	0,00
5,814 % fällig am 12.06.2044	£	1.426	1.630	0,00
Rochester Financing PLC				
5,602 % fällig am 18.12.2044		2.308	2.900	0,01
Roundstone Securities DAC				
0,000 % fällig am 28.09.2055	€	19.776	17.901	0,03
1,000 % fällig am 28.09.2055		3.941	3.995	0,01
4,177 % fällig am 28.09.2055		114.649	124.810	0,19
4,327 % fällig am 28.09.2055		15.538	16.864	0,03
4,577 % fällig am 28.09.2055		10.594	11.481	0,02
5,077 % fällig am 28.09.2055		6.356	6.876	0,01
5,827 % fällig am 28.09.2055		10.594	11.408	0,02
Sequoia Mortgage Trust				
3,723 % fällig am 20.07.2037	$	1.460	1.180	0,00
4,015 % fällig am 20.06.2037 ^		3.345	2.735	0,01
5,477 % fällig am 20.11.2034		656	604	0,00
5,708 % fällig am 20.02.2034		240	214	0,00
Sestante Finance SRL				
3,431 % fällig am 23.07.2046	€	15.709	16.223	0,03
Shamrock Residential DAC				
4,289 % fällig am 24.12.2059		25.205	27.231	0,04
4,289 % fällig am 24.01.2061		43.992	47.491	0,07
4,439 % fällig am 24.06.2071		30.157	32.573	0,05
4,689 % fällig am 24.02.2071		43.377	47.055	0,07
Stratton BTL Mortgage Funding PLC				
5,221 % fällig am 20.01.2054	£	23.789	30.088	0,05
Stratton Hawksmoor PLC				
6,266 % fällig am 25.02.2053		63.113	79.524	0,12
6,516 % fällig am 25.02.2053		37.882	47.096	0,07
6,766 % fällig am 25.02.2053		29.847	36.476	0,06
Stratton Mortgage Funding PLC				
5,391 % fällig am 20.07.2060		96.944	123.261	0,19
5,765 % fällig am 12.03.2052		12.568	15.923	0,03
5,792 % fällig am 25.09.2051		28.847	36.590	0,06
5,991 % fällig am 20.07.2060		9.236	11.692	0,02
Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust				
3,663 % fällig am 25.10.2036	$	2.095	1.881	0,00
4,045 % fällig am 25.07.2035 ^		663	569	0,00
4,200 % fällig am 25.02.2036 ^		2.975	2.407	0,00
4,237 % fällig am 25.07.2035 ^		172	101	0,00
4,300 % fällig am 25.08.2036		3.169	2.247	0,00

BESCHREIBUNG		PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
4,348 % fällig am 25.11.2035	$	48	$ 35	0,00
4,472 % fällig am 25.05.2036		855	636	0,00
4,508 % fällig am 25.11.2037 ^		324	271	0,00
4,556 % fällig am 25.11.2037 ^		200	141	0,00
4,892 % fällig am 25.01.2035		204	189	0,00
5,227 % fällig am 25.09.2034		2	2	0,00
5,348 % fällig am 25.04.2036		322	269	0,00
5,375 % fällig am 25.02.2035		2.648	2.528	0,01
5,450 % fällig am 25.09.2034		311	279	0,00
5,462 % fällig am 25.01.2035		49	45	0,00
5,470 % fällig am 25.01.2037		2.009	1.725	0,00
5,570 % fällig am 25.10.2035		1.999	1.831	0,00
5,590 % fällig am 25.05.2037		781	688	0,00
5,630 % fällig am 25.05.2037 ^		1.423	1.244	0,00
5,700 % fällig am 25.09.2034		4.336	3.747	0,01
5,773 % fällig am 25.10.2035 ^		88	78	0,00
6,063 % fällig am 25.12.2034		17	17	0,00
6,125 % fällig am 25.08.2035		1.736	1.538	0,00
Structured Asset Mortgage Investments Trust				
3,363 % fällig am 19.10.2034		295	247	0,00
3,547 % fällig am 25.05.2047 ^		3.128	2.574	0,01
3,992 % fällig am 27.12.2035 ^		43	42	0,00
5,270 % fällig am 25.08.2036		9.279	8.057	0,01
5,270 % fällig am 25.10.2036		4.015	3.529	0,01
5,320 % fällig am 25.02.2036		2.057	1.713	0,00
5,330 % fällig am 25.01.2037		2.095	1.861	0,00
5,330 % fällig am 25.09.2047		194	176	0,00
5,370 % fällig am 25.09.2047		9.558	7.974	0,01
5,376 % fällig am 25.12.2035 ^		1.285	1.044	0,00
5,470 % fällig am 25.01.2037		3.222	2.845	0,01
5,510 % fällig am 25.07.2046		4.040	3.363	0,01
5,550 % fällig am 25.02.2036		312	246	0,00
5,570 % fällig am 25.05.2036		2.498	1.684	0,00
5,570 % fällig am 25.09.2047 ^		13.432	11.125	0,02
5,590 % fällig am 25.05.2036		10.208	8.186	0,01
5,610 % fällig am 25.02.2036 ^		1.221	1.066	0,00
5,610 % fällig am 25.05.2045		54	49	0,00
5,626 % fällig am 19.04.2035		3	3	0,00
5,646 % fällig am 19.07.2035		36	33	0,00
5,700 % fällig am 25.09.2047 ^		5.275	4.332	0,01
5,710 % fällig am 25.02.2036 ^		79	67	0,00
5,746 % fällig am 19.07.2034		508	455	0,00
5,750 % fällig am 25.08.2036 ^		6.458	4.585	0,01
5,846 % fällig am 19.12.2034		129	115	0,00
6,271 % fällig am 19.12.2033		352	331	0,00
Structured Asset Securities Corp.				
5,400 % fällig am 25.07.2035		1.791	1.626	0,00
Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust				
5,400 % fällig am 25.05.2036		1.986	1.601	0,00
SunTrust Adjustable Rate Mortgage Loan Trust				
3,732 % fällig am 25.10.2037 ^		626	552	0,00
4,167 % fällig am 25.06.2037		1.023	939	0,00
TBW Mortgage-Backed Trust				
5,500 % fällig am 25.07.2036 ^		10	1	0,00
5,965 % fällig am 25.07.2037		3.683	1.177	0,00
6,450 % fällig am 25.03.2037		13.360	3.242	0,01
TDA Mixto Fondo de Titulizacion de Activos				
3,767 % fällig am 22.06.2040	€	6.051	6.083	0,01
Temple Quay PLC				
6,524 % fällig am 24.07.2085	£	15.905	19.977	0,03
7,524 % fällig am 24.07.2085		14.681	18.443	0,03
Terwin Mortgage Trust				
4,124 % fällig am 25.10.2037	$	5.309	1.971	0,00
Tharaldson Hotel Portfolio Trust				
6,591 % fällig am 11.11.2034		27.138	26.715	0,04
6,841 % fällig am 11.11.2034		13.609	13.296	0,02
7,491 % fällig am 11.11.2034		25.064	24.306	0,04
Thornburg Mortgage Securities Trust				
2,553 % fällig am 25.03.2044		686	668	0,00
3,002 % fällig am 25.04.2036		927	841	0,00
3,018 % fällig am 25.09.2037		464	452	0,00
3,114 % fällig am 25.09.2037		1.167	1.134	0,00
3,442 % fällig am 25.10.2046		47	44	0,00
3,889 % fällig am 25.07.2036		1.375	1.139	0,00
7,151 % fällig am 25.06.2037		105	90	0,00
Towd Point Mortgage Funding PLC				
5,161 % fällig am 20.10.2051	£	16.600	20.891	0,03
5,541 % fällig am 20.10.2051		13.000	16.152	0,03
5,635 % fällig am 20.10.2051		5.459	6.950	0,01
5,691 % fällig am 20.10.2051		6.118	7.686	0,01
5,841 % fällig am 20.07.2045		36.259	46.118	0,07

BESCHREIBUNG		PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
5,891 % fällig am 20.10.2051	£	4.000	$ 5.019	0,01
6,097 % fällig am 20.05.2045		51.349	65.094	0,10
6,216 % fällig am 20.02.2045		15.162	19.242	0,03
6,541 % fällig am 20.10.2051		13.500	16.776	0,03
6,546 % fällig am 20.02.2054		34.671	44.091	0,07
6,991 % fällig am 20.10.2051		4.500	5.567	0,01
Towd Point Mortgage Trust				
2,750 % fällig am 25.06.2057	$	6.150	5.802	0,01
2,750 % fällig am 25.10.2057		10.062	9.555	0,02
3,750 % fällig am 25.04.2055		6.605	6.236	0,01
Tower Bridge Funding PLC				
5,629 % fällig am 20.12.2063	£	3.906	4.944	0,01
5,847 % fällig am 20.11.2063		1.500	1.879	0,00
Trinidad Mortgage Securities PLC				
5,443 % fällig am 24.01.2059		1.930	2.453	0,00
Trinity Square PLC				
5,866 % fällig am 15.07.2059		34.300	43.367	0,07
6,166 % fällig am 15.07.2059		12.400	15.629	0,03
6,466 % fällig am 15.07.2059		9.600	11.986	0,02
7,216 % fällig am 15.07.2059		5.700	7.110	0,01
Tudor Rose Mortgages				
5,509 % fällig am 20.06.2048		6.744	8.527	0,01
Twin Bridges PLC				
0,000 % fällig am 14.06.2055		38.700	49.050	0,08
6,115 % fällig am 12.12.2054		23.543	29.994	0,05
6,865 % fällig am 12.06.2055		5.819	7.401	0,01
Uropa Securities PLC				
3,255 % fällig am 10.10.2040	€	6.136	6.433	0,01
4,879 % fällig am 10.10.2040	£	6.899	8.287	0,01
Verus Securitization Trust				
1,977 % fällig am 25.03.2060	$	439	428	0,00
3,035 % fällig am 25.03.2060		700	666	0,00
3,889 % fällig am 25.03.2060		1.000	942	0,00
Wachovia Mortgage Loan Trust				
1,560 % fällig am 25.01.2037		2.082	800	0,00
1,679 % fällig am 25.08.2036		1.309	468	0,00
Wachovia Mortgage Loan Trust LLC				
4,291 % fällig am 20.10.2035 ^		218	205	0,00
4,654 % fällig am 20.08.2035 ^		138	132	0,00
WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust				
3,053 % fällig am 25.01.2037 ^		797	667	0,00
3,307 % fällig am 25.01.2037 ^		2.688	2.363	0,00
3,342 % fällig am 25.11.2036 ^		3.085	2.655	0,01
3,435 % fällig am 25.12.2036 ^		665	581	0,00
3,472 % fällig am 25.03.2037 ^		985	784	0,00
3,528 % fällig am 25.12.2036 ^		6.304	5.546	0,01
3,626 % fällig am 25.09.2036		4.019	3.490	0,01
3,630 % fällig am 25.09.2036 ^		114	93	0,00
3,633 % fällig am 25.12.2036		506	438	0,00
3,633 % fällig am 25.12.2036 ^		208	180	0,00
3,651 % fällig am 25.02.2037 ^		1.466	1.273	0,00
3,669 % fällig am 25.02.2037 ^		3.835	3.469	0,01
3,693 % fällig am 25.08.2046 ^		912	819	0,00
3,753 % fällig am 25.02.2037 ^		8.415	7.699	0,01
3,772 % fällig am 25.02.2037 ^		1.716	1.540	0,00
3,781 % fällig am 25.08.2046 ^		186	162	0,00
3,781 % fällig am 25.08.2046 ^		285	254	0,00
3,784 % fällig am 25.06.2037 ^		1.515	1.331	0,00
3,809 % fällig am 25.07.2037 ^		4.569	4.219	0,01
3,816 % fällig am 25.10.2036 ^		2.700	2.448	0,00
3,816 % fällig am 25.10.2036		1.437	1.303	0,00
3,823 % fällig am 27.02.2034		8	7	0,00
3,824 % fällig am 25.06.2037 ^		1.305	1.157	0,00
3,894 % fällig am 25.05.2037 ^		1.139	949	0,00
3,900 % fällig am 25.12.2035		5.435	5.144	0,01
3,913 % fällig am 25.04.2035		1.426	1.352	0,00
3,923 % fällig am 25.05.2037		1.403	1.189	0,00
4,003 % fällig am 25.06.2037 ^		941	856	0,00
4,008 % fällig am 25.12.2046 ^		5.187	4.443	0,01
4,008 % fällig am 25.12.2046		1.877	1.667	0,00
4,029 % fällig am 25.08.2036 ^		172	144	0,00
4,029 % fällig am 25.08.2036 ^		642	550	0,00
4,079 % fällig am 25.03.2035		2.002	1.940	0,00
4,081 % fällig am 25.07.2037 ^		3.734	3.489	0,01
4,156 % fällig am 25.03.2037		115	105	0,00
4,198 % fällig am 25.01.2035		1.774	1.626	0,00
4,404 % fällig am 25.05.2046		42	36	0,00
4,676 % fällig am 25.02.2047 ^		2.407	2.055	0,00
4,676 % fällig am 25.03.2047 ^		518	450	0,00
4,726 % fällig am 25.06.2047		11.728	9.579	0,02
4,736 % fällig am 25.04.2047		216	190	0,00

BESCHREIBUNG		PAR (000S)		MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
4,746 % fällig am 25.04.2047 ^	$	1.748	$	1.485	0,00
4,746 % fällig am 25.05.2047		4.493		3.640	0,01
4,756 % fällig am 25.07.2034		187		114	0,00
4,774 % fällig am 25.07.2047 ^		1.535		1.332	0,00
4,786 % fällig am 25.07.2047		12.338		10.065	0,02
4,856 % fällig am 25.10.2046 ^		6.169		5.299	0,01
4,896 % fällig am 25.09.2046 ^		3.108		2.761	0,01
4,966 % fällig am 25.06.2046		1.651		1.461	0,00
4,976 % fällig am 25.02.2046		2.461		2.197	0,00
5,024 % fällig am 25.08.2046		2.201		1.814	0,00
5,226 % fällig am 25.01.2047		4.863		4.382	0,01
5,476 % fällig am 25.09.2046		2.281		2.140	0,00
5,476 % fällig am 25.10.2046		1.967		1.779	0,00
5,476 % fällig am 25.11.2046		1.779		1.569	0,00
5,690 % fällig am 25.07.2045		533		506	0,00
5,770 % fällig am 25.01.2045		827		812	0,00
5,850 % fällig am 25.12.2045		1.531		1.389	0,00
5,870 % fällig am 25.10.2045		114		107	0,00
5,890 % fällig am 25.01.2045		2.012		1.983	0,00
5,950 % fällig am 25.06.2044		116		107	0,00
6,050 % fällig am 25.10.2045		7.311		6.085	0,01
6,130 % fällig am 25.10.2045		354		333	0,00
6,150 % fällig am 25.12.2045		5.907		5.754	0,01
6,170 % fällig am 25.08.2045		4.180		3.972	0,01
Warwick Finance Residential Mortgages PLC					
0,000 % fällig am 21.12.2049 (f)	£	2		10.406	0,02
5,865 % fällig am 21.12.2049		59.121		74.806	0,12
5,933 % fällig am 21.03.2042		2.586		3.278	0,01
6,564 % fällig am 21.12.2049		12.810		16.132	0,03
7,064 % fällig am 21.12.2049		6.405		8.023	0,01
7,564 % fällig am 21.12.2049		3.660		4.569	0,01
8,064 % fällig am 21.12.2049		3.660		4.493	0,01
Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates Trust					
4,022 % fällig am 25.09.2036 ^	$	605		191	0,00
4,163 % fällig am 25.10.2036 ^		9.635		3.653	0,01
4,300 % fällig am 25.10.2036 ^		3.945		1.140	0,00
4,736 % fällig am 25.04.2047 ^		4.313		3.590	0,01
4,806 % fällig am 25.11.2046		101		86	0,00
4,896 % fällig am 25.09.2046 ^		3.789		3.035	0,01
4,916 % fällig am 25.04.2046		3.989		3.361	0,01
4,916 % fällig am 25.07.2046 ^		6.098		3.812	0,01
4,936 % fällig am 25.08.2046		3.693		2.084	0,00
5,226 % fällig am 25.04.2047		17.753		14.995	0,02
5,470 % fällig am 25.02.2037 ^		718		545	0,00
5,500 % fällig am 25.05.2035 ^		3.093		2.438	0,00
5,500 % fällig am 25.07.2035 ^		958		863	0,00
5,500 % fällig am 25.07.2035 ^		53		47	0,00
5,500 % fällig am 25.11.2035 ^		88		76	0,00
5,500 % fällig am 25.02.2036 ^		1.289		1.124	0,00
5,530 % fällig am 25.06.2037		407		372	0,00
5,670 % fällig am 25.12.2035		2.796		2.455	0,00
5,750 % fällig am 25.01.2036 ^		2.092		1.727	0,00
5,750 % fällig am 25.02.2036 ^		127		111	0,00
6,000 % fällig am 25.11.2035 ^		2.310		2.198	0,00
6,000 % fällig am 25.07.2036		4.432		3.306	0,01
6,000 % fällig am 25.04.2037		2.219		1.898	0,00
6,500 % fällig am 25.11.2035 ^		3.387		1.971	0,00
6,500 % fällig am 25.03.2036 ^		3.175		2.253	0,00
6,812 % fällig am 25.07.2036 ^		10.797		2.808	0,01
6,949 % fällig am 25.07.2036 ^		1.963		510	0,00
7,000 % fällig am 25.02.2036		2.674		2.051	0,00
7,000 % fällig am 25.05.2036 ^		3.021		2.546	0,01
Washington Mutual MSC Mortgage Pass-Through Certificates Trust					
4,192 % fällig am 25.01.2035		182		163	0,00
Wells Fargo Alternative Loan Trust					
0,920 % fällig am 25.06.2037 (a)		798		57	0,00
5,500 % fällig am 25.06.2037 ^		1.108		781	0,00
5,580 % fällig am 25.06.2037		798		644	0,00
6,250 % fällig am 25.07.2037 ^		2.910		2.466	0,00
6,250 % fällig am 25.11.2037 ^		1.259		1.076	0,00
Wells Fargo Mortgage-Backed Securities Trust					
4,299 % fällig am 25.04.2037		520		447	0,00
4,417 % fällig am 25.11.2037 ^		267		231	0,00
4,495 % fällig am 25.10.2036 ^		95		83	0,00
4,563 % fällig am 25.12.2036 ^		738		714	0,00
4,564 % fällig am 25.03.2036		1.171		1.073	0,00
4,564 % fällig am 25.10.2036		2.417		2.257	0,00
4,590 % fällig am 25.08.2035		806		776	0,00
4,646 % fällig am 25.10.2037 ^		80		68	0,00
4,692 % fällig am 25.04.2036		1.672		1.576	0,00
4,716 % fällig am 25.09.2036 ^	$	1.112	$	1.070	0,00
4,890 % fällig am 25.08.2036 ^		1.036		970	0,00
5,500 % fällig am 25.12.2021		1		1	0,00
6,000 % fällig am 25.06.2037 ^		796		698	0,00
Wells Fargo-RBS Commercial Mortgage Trust					
0,628 % fällig am 15.03.2047 (a)		83.200		280	0,00
0,772 % fällig am 15.03.2047 (a)		65.193		157	0,00
Worldwide Plaza Trust					
3,715 % fällig am 10.11.2036		62.600		40.697	0,06
				7.638.196	11,83

FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE

BESCHREIBUNG		PAR (000S)		MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
Aames Mortgage Investment Trust					
5,930 % fällig am 25.10.2035		9.464		9.283	0,02
AccessLex Institute					
5,344 % fällig am 26.09.2033		4.695		4.524	0,01
Accredited Mortgage Loan Trust					
5,370 % fällig am 25.02.2037		1.000		944	0,00
5,410 % fällig am 25.09.2036		4.948		4.868	0,01
5,420 % fällig am 25.09.2036		12.235		11.240	0,02
5,420 % fällig am 25.02.2037		9.754		8.183	0,01
5,610 % fällig am 25.12.2035 ^		13.735		9.716	0,02
6,020 % fällig am 25.09.2035		5.921		5.415	0,01
6,170 % fällig am 25.07.2035		2.496		2.311	0,00
6,230 % fällig am 25.10.2034		1.640		1.534	0,00
ACE Securities Corp. Home Equity Loan Trust					
5,270 % fällig am 25.12.2036		10.754		5.736	0,01
5,320 % fällig am 25.11.2036		18.715		7.907	0,01
5,390 % fällig am 25.08.2036 ^		8.609		2.185	0,00
5,390 % fällig am 25.01.2037		1.171		690	0,00
5,410 % fällig am 25.12.2036		25.726		14.122	0,02
5,430 % fällig am 25.07.2036		5.237		4.736	0,01
5,450 % fällig am 25.07.2036		32.762		12.178	0,02
5,460 % fällig am 25.08.2036		5.166		4.897	0,01
5,490 % fällig am 25.01.2037		3.838		2.261	0,00
5,590 % fällig am 25.12.2036		197		69	0,00
5,590 % fällig am 25.01.2037		10.616		2.706	0,00
5,630 % fällig am 25.04.2036		6.285		5.733	0,01
5,630 % fällig am 25.07.2036		7.178		2.191	0,00
5,650 % fällig am 25.01.2037		1.171		690	0,00
5,710 % fällig am 25.06.2037		1.634		1.460	0,00
5,750 % fällig am 25.02.2036		627		615	0,00
5,765 % fällig am 25.12.2035		4.200		3.745	0,01
5,810 % fällig am 25.11.2035		1.855		1.864	0,00
5,840 % fällig am 25.05.2035		148		144	0,00
6,050 % fällig am 25.12.2034		3.371		3.022	0,01
6,050 % fällig am 25.08.2035		3.311		3.182	0,01
6,095 % fällig am 25.05.2035		3.000		2.674	0,00
6,125 % fällig am 25.11.2033		694		665	0,00
6,170 % fällig am 25.04.2035		1.215		1.165	0,00
6,950 % fällig am 25.06.2034		4		4	0,00
Aegis Asset-Backed Securities Trust					
5,320 % fällig am 25.01.2037		1.210		920	0,00
5,795 % fällig am 25.12.2035		3.690		3.313	0,01
5,870 % fällig am 25.06.2035		2.462		2.290	0,00
5,870 % fällig am 25.08.2035		751		722	0,00
5,900 % fällig am 25.03.2035		6.447		5.130	0,01
Aegis Asset-Backed Securities Trust Mortgage Pass-Through Certificates					
5,855 % fällig am 25.10.2035		2.449		2.244	0,00
6,875 % fällig am 25.10.2034		1.719		1.696	0,00
ALESCO Preferred Funding Ltd.					
5,820 % fällig am 23.12.2037		27.732		25.375	0,04
5,860 % fällig am 23.09.2037		7.010		6.099	0,01
5,900 % fällig am 23.06.2036		17.016		15.654	0,03
5,920 % fällig am 23.12.2035		8.102		7.616	0,01
5,940 % fällig am 23.09.2037		2.000		1.480	0,00
5,990 % fällig am 23.12.2036		5.000		3.850	0,01
6,290 % fällig am 23.09.2038		6.781		6.103	0,01
Ameriquest Mortgage Securities Trust					
5,250 % fällig am 25.10.2036		21.718		6.583	0,01
5,325 % fällig am 25.10.2036		12.086		6.612	0,01
5,660 % fällig am 25.04.2036		525		519	0,00
5,705 % fällig am 25.04.2036		6.319		5.914	0,01
Ameriquest Mortgage Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates					
2,817 % fällig am 25.06.2033		477		437	0,00
2,817 % fällig am 25.06.2033 ^		910		815	0,00
4,039 % fällig am 25.11.2034		3.695		3.553	0,01
4,165 % fällig am 25.06.2034		1.814		1.658	0,00
4,261 % fällig am 25.07.2034	$	318	$	316	0,00
4,684 % fällig am 25.12.2033		285		267	0,00
5,825 % fällig am 25.01.2036		9.847		9.647	0,02
5,855 % fällig am 25.01.2036		1.026		1.020	0,00
5,900 % fällig am 25.01.2036		5.050		4.855	0,01
5,915 % fällig am 25.10.2035		330		328	0,00
5,945 % fällig am 25.03.2035		58		57	0,00
6,020 % fällig am 25.11.2035		6.710		6.222	0,01
6,080 % fällig am 25.05.2035		1.966		1.929	0,00
6,110 % fällig am 25.10.2035		6.196		5.550	0,01
6,125 % fällig am 25.05.2035		2.000		1.895	0,00
6,125 % fällig am 25.07.2035		11.155		10.325	0,02
6,125 % fällig am 25.09.2035		5.750		4.612	0,01
6,170 % fällig am 25.09.2034		258		251	0,00
6,170 % fällig am 25.01.2035 ^		2.011		1.797	0,00
6,200 % fällig am 25.05.2035		1.961		1.765	0,00
6,245 % fällig am 25.09.2034		3.520		3.142	0,01
6,710 % fällig am 25.01.2035		1.591		1.314	0,00
6,800 % fällig am 25.11.2034		2.642		2.367	0,00
6,875 % fällig am 25.08.2035		2.000		1.705	0,00
7,025 % fällig am 25.07.2034		1.546		1.476	0,00
7,910 % fällig am 25.05.2034		1.323		1.140	0,00
Ares European CLO DAC					
3,787 % fällig am 15.04.2030	€	1.967		2.105	0,00
4,127 % fällig am 15.01.2036		4.200		4.443	0,01
4,325 % fällig am 21.10.2033		28.450		30.526	0,05
Argent Securities Trust					
5,260 % fällig am 25.09.2036	$	13.789		4.544	0,01
5,370 % fällig am 25.05.2036		4.017		996	0,00
5,390 % fällig am 25.09.2036		10.806		3.561	0,01
5,450 % fällig am 25.06.2036		15.555		10.180	0,02
5,450 % fällig am 25.07.2036		33.857		28.871	0,05
5,470 % fällig am 25.05.2036		11.515		2.856	0,01
5,500 % fällig am 25.04.2036		1.577		919	0,00
5,530 % fällig am 25.03.2036		14.028		10.582	0,02
5,690 % fällig am 25.05.2036		681		169	0,00
Argent Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates					
5,620 % fällig am 25.01.2036		7.523		7.275	0,01
5,630 % fällig am 25.05.2035		8.290		7.474	0,01
5,810 % fällig am 25.11.2035		9.420		9.055	0,01
5,910 % fällig am 25.02.2036		12.641		9.661	0,02
5,915 % fällig am 25.10.2035		5.750		5.129	0,01
6,050 % fällig am 25.05.2034		313		257	0,00
6,275 % fällig am 25.11.2034		2.801		2.746	0,01
Asset-Backed Funding Certificates Trust					
5,280 % fällig am 25.01.2037		493		343	0,00
5,290 % fällig am 25.10.2036		842		769	0,00
5,310 % fällig am 25.01.2037		11.141		6.465	0,01
5,370 % fällig am 25.10.2036		9.718		8.069	0,01
5,370 % fällig am 25.01.2037		3.672		2.135	0,00
5,430 % fällig am 25.11.2036		9.710		5.745	0,01
5,450 % fällig am 25.05.2037		2.690		2.486	0,00
5,570 % fällig am 25.09.2036 ^		6.390		5.668	0,01
5,810 % fällig am 25.03.2035		3.740		3.596	0,01
5,850 % fällig am 25.06.2034		2.921		2.839	0,01
5,930 % fällig am 25.11.2033		954		895	0,00
6,050 % fällig am 25.02.2034		199		195	0,00
Asset-Backed Securities Corp. Home Equity Loan Trust					
2,977 % fällig am 25.03.2036		2.345		1.888	0,00
2,977 % fällig am 25.03.2036		58		55	0,00
3,240 % fällig am 25.03.2036		1.062		901	0,00
3,500 % fällig am 25.12.2036		2.161		2.059	0,00
3,688 % fällig am 25.12.2036		3.771		3.375	0,01
5,495 % fällig am 25.11.2036		5.531		5.112	0,01
5,960 % fällig am 25.06.2034		815		773	0,00
6,050 % fällig am 25.11.2035		3.597		3.323	0,01
6,125 % fällig am 25.11.2033		903		894	0,00
6,125 % fällig am 25.05.2035		247		239	0,00
6,125 % fällig am 25.06.2035 ^		2.510		2.115	0,00
6,170 % fällig am 25.07.2035		3.500		3.327	0,01
6,995 % fällig am 25.05.2035		1.464		1.323	0,00
Atlas Senior Loan Fund Ltd.					
6,120 % fällig am 20.04.2028		1.012		1.013	0,00
Aurium CLO DAC					
3,847 % fällig am 16.04.2030	€	29.741		31.864	0,05
Auto Abs Spanish Loans					
5,229 % fällig am 28.02.2032		6.104		6.563	0,01
5,929 % fällig am 28.02.2032		9.847		10.448	0,02
Bain Capital Euro CLO DAC					
4,077 % fällig am 15.04.2032		10.000		10.652	0,02

BESCHREIBUNG		PAR (000S)		MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
Bastille Euro CLO DAC					
4,327 % fällig am 15.01.2034	€	20.000	$	21.258	0,03
Bayview Financial Mortgage Pass-Through Trust					
6,048 % fällig am 28.04.2036	$	1.237		1.201	0,00
Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust					
4,037 % fällig am 25.07.2036		57		54	0,00
4,477 % fällig am 25.11.2035 ^		1.863		1.748	0,00
4,655 % fällig am 25.10.2036		53		52	0,00
4,655 % fällig am 25.10.2036		50		47	0,00
4,705 % fällig am 25.12.2035		121		121	0,00
4,993 % fällig am 25.12.2035		2.334		2.009	0,00
4,998 % fällig am 25.09.2034		1.407		1.371	0,00
4,998 % fällig am 25.09.2034		91		82	0,00
5,082 % fällig am 25.11.2034		375		370	0,00
5,085 % fällig am 25.04.2036		1.885		1.873	0,00
5,087 % fällig am 25.08.2034		452		421	0,00
5,161 % fällig am 25.01.2035		2.578		2.503	0,00
5,290 % fällig am 25.03.2037		2.075		1.860	0,00
5,310 % fällig am 25.01.2037		7.337		7.274	0,01
5,380 % fällig am 25.02.2037		1.500		1.364	0,00
5,400 % fällig am 25.04.2037 ^		1.639		2.320	0,00
5,430 % fällig am 25.11.2036		513		497	0,00
5,450 % fällig am 25.06.2047		161		154	0,00
5,490 % fällig am 25.05.2035		11		11	0,00
5,490 % fällig am 25.12.2036		9.843		9.354	0,02
5,500 % fällig am 25.06.2047		7.641		6.414	0,01
5,510 % fällig am 25.10.2036		925		914	0,00
5,527 % fällig am 25.02.2034		249		245	0,00
5,600 % fällig am 25.01.2047		2.137		2.041	0,00
5,650 % fällig am 25.08.2036		5.489		4.949	0,01
5,650 % fällig am 25.05.2037		2.241		2.105	0,00
5,670 % fällig am 25.09.2036 ^		2.206		1.900	0,00
5,885 % fällig am 25.09.2035		155		154	0,00
6,155 % fällig am 25.06.2035		3.578		3.426	0,01
6,170 % fällig am 25.10.2035		1.813		1.767	0,00
6,200 % fällig am 25.08.2037		10.565		8.867	0,01
6,275 % fällig am 25.02.2035		745		741	0,00
6,350 % fällig am 25.06.2036		616		596	0,00
6,500 % fällig am 25.10.2036 ^		2.297		1.035	0,00
7,100 % fällig am 25.11.2039		944		949	0,00
8,300 % fällig am 25.12.2042		1.522		1.620	0,00
Bear Stearns Structured Products, Inc. Trust					
7,150 % fällig am 25.03.2037		2.151		1.980	0,00
Blackrock European CLO DAC					
4,027 % fällig am 15.07.2030	€	8.978		9.659	0,02
BNC Mortgage Loan Trust					
3,821 % fällig am 25.10.2036	$	5.656		4.089	0,01
5,310 % fällig am 25.03.2037		10.205		9.517	0,02
5,400 % fällig am 25.07.2037		9.737		8.163	0,01
5,460 % fällig am 25.05.2037		5.954		5.408	0,01
5,470 % fällig am 25.11.2036		1.184		1.129	0,00
BNPP AM Euro CLO DAC					
3,827 % fällig am 15.10.2031	€	11.680		12.452	0,02
Bombardier Capital Mortgage Securitization Corp. Trust					
7,180 % fällig am 15.12.2029	$	980		125	0,00
7,440 % fällig am 15.12.2029		10.140		1.337	0,00
7,575 % fällig am 15.06.2030		936		120	0,00
Cairn CLO DAC					
3,912 % fällig am 31.01.2030	€	25.564		27.465	0,04
Camber PLC					
1,571 % fällig am 09.11.2053	$	30.714		182	0,00
Capitalsource Real Estate Loan Trust					
5,861 % fällig am 20.01.2037		8.401		7.739	0,01
5,961 % fällig am 20.01.2037		5.400		4.514	0,01
6,061 % fällig am 20.01.2037		3.000		2.453	0,00
Carbone CLO Ltd.					
6,390 % fällig am 20.01.2031		4.294		4.264	0,01
Carrington Mortgage Loan Trust					
5,300 % fällig am 25.04.2036 ^		2.105		2.010	0,00
5,300 % fällig am 25.08.2036		8.951		8.456	0,01
5,310 % fällig am 25.10.2036		11.722		11.291	0,02
5,410 % fällig am 25.02.2037		14.783		13.377	0,02
5,750 % fällig am 25.01.2036		1.064		1.015	0,00
5,900 % fällig am 25.10.2035		7.368		7.046	0,01
5,945 % fällig am 25.09.2035		2.517		2.403	0,00
6,140 % fällig am 25.06.2035		5.786		5.635	0,01
6,200 % fällig am 25.05.2035		4.475		4.283	0,01
Centex Home Equity Loan Trust					
5,600 % fällig am 25.06.2036		88		86	0,00
5,630 % fällig am 25.06.2036		1.300		1.255	0,00

BESCHREIBUNG		PAR (000S)		MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
5,870 % fällig am 25.01.2035	$	1.305	$	1.292	0,00
5,900 % fällig am 25.01.2035		1.492		1.449	0,00
6,060 % fällig am 25.09.2034		666		638	0,00
6,065 % fällig am 25.10.2035		6		6	0,00
6,080 % fällig am 25.09.2034		203		196	0,00
6,110 % fällig am 25.03.2035		3.157		2.984	0,01
Chase Funding Trust					
5,900 % fällig am 25.09.2033		0		0	0,00
CIT Mortgage Loan Trust					
6,500 % fällig am 25.10.2037		2.357		2.353	0,00
6,650 % fällig am 25.10.2037		71.896		69.992	0,11
Citigroup Mortgage Loan Trust					
4,277 % fällig am 25.10.2037		421		384	0,00
5,220 % fällig am 25.05.2037		1.964		1.289	0,00
5,290 % fällig am 25.01.2037		10.152		9.201	0,02
5,325 % fällig am 25.05.2037		347		328	0,00
5,330 % fällig am 25.01.2037		14.058		10.316	0,02
5,350 % fällig am 25.05.2037		4.273		2.819	0,01
5,410 % fällig am 25.07.2045		4.224		2.955	0,01
5,420 % fällig am 25.05.2037		25.116		22.951	0,04
5,430 % fällig am 25.12.2036		3.545		3.353	0,01
5,440 % fällig am 25.09.2036		5.939		5.616	0,01
5,450 % fällig am 25.12.2036		944		381	0,00
5,470 % fällig am 25.09.2036		1.422		1.039	0,00
5,470 % fällig am 25.12.2036		17.972		10.103	0,02
5,550 % fällig am 25.11.2046		4.689		4.496	0,01
5,570 % fällig am 25.12.2036		3.787		3.698	0,01
5,570 % fällig am 25.01.2037		2.382		2.326	0,00
5,600 % fällig am 25.01.2037		434		399	0,00
5,630 % fällig am 25.08.2036		3.018		2.654	0,00
5,650 % fällig am 25.08.2036		494		479	0,00
5,670 % fällig am 25.03.2036		3.876		3.462	0,01
5,750 % fällig am 25.12.2035 ^		1.747		1.653	0,00
5,775 % fällig am 25.10.2036		995		654	0,00
6,352 % fällig am 25.05.2036 ^		1.028		412	0,00
6,851 % fällig am 25.05.2036 ^		518		207	0,00
7,250 % fällig am 25.05.2036		11.910		6.345	0,01
Citigroup Mortgage Loan Trust Asset-Backed Pass-Through Certificates					
6,155 % fällig am 25.10.2034		3.643		3.169	0,01
Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.					
5,410 % fällig am 25.03.2037		5.597		4.739	0,01
5,500 % fällig am 25.03.2037		1.983		1.636	0,00
5,585 % fällig am 25.11.2036		4.469		4.354	0,01
5,600 % fällig am 25.10.2036		3.496		3.464	0,01
5,615 % fällig am 25.08.2036		2.101		1.884	0,00
5,645 % fällig am 25.10.2036		400		383	0,00
5,780 % fällig am 25.02.2035		1.955		1.785	0,00
5,825 % fällig am 25.10.2035 ^		2.193		2.120	0,00
5,885 % fällig am 25.09.2035 ^		2.375		2.345	0,00
5,930 % fällig am 25.01.2036		792		785	0,00
6,830 % fällig am 25.07.2035		3.840		3.026	0,01
Commonbond Student Loan Trust					
2,550 % fällig am 25.05.2041		2.001		1.848	0,00
6,000 % fällig am 25.05.2041		118		116	0,00
Conseco Finance Corp.					
6,560 % fällig am 01.11.2028		979		970	0,00
6,920 % fällig am 01.12.2030		2.506		2.505	0,00
7,060 % fällig am 01.02.2031		1.430		1.269	0,00
7,500 % fällig am 01.03.2030		12.877		5.030	0,01
7,850 % fällig am 15.11.2026		21		21	0,00
7,860 % fällig am 01.03.2030		4.756		1.931	0,00
Conseco Finance Securitizations Corp.					
6,977 % fällig am 01.09.2033		1.718		1.688	0,00
7,100 % fällig am 01.02.2033		68		67	0,00
7,770 % fällig am 01.09.2031		836		824	0,00
7,970 % fällig am 01.05.2032		1.887		370	0,00
8,060 % fällig am 01.09.2029		14.402		3.033	0,01
8,260 % fällig am 01.12.2030		13.372		3.495	0,01
8,310 % fällig am 01.05.2032		20.172		4.120	0,01
Countrywide Asset-Backed Certificates					
5,430 % fällig am 25.03.2037		2.180		2.074	0,00
5,630 % fällig am 25.04.2037		763		623	0,00
5,645 % fällig am 25.03.2037 ^		7.290		6.268	0,01
5,650 % fällig am 25.01.2046 ^		11.978		11.186	0,02
5,900 % fällig am 25.05.2034		222		220	0,00
6,050 % fällig am 25.03.2047 ^		1.496		1.231	0,00
Countrywide Asset-Backed Certificates Trust					
3,221 % fällig am 25.04.2036		3.029		2.799	0,01
3,468 % fällig am 25.03.2035		3.700		2.893	0,01
3,468 % fällig am 25.04.2035		1.301		1.244	0,00

BESCHREIBUNG		PAR (000S)		MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
3,820 % fällig am 25.12.2034	$	929	$	913	0,00
3,903 % fällig am 25.01.2037		6.842		6.657	0,01
4,033 % fällig am 25.01.2037		13.000		11.904	0,02
4,225 % fällig am 25.05.2036		24.922		24.000	0,04
4,342 % fällig am 25.10.2046 ^		8.315		8.053	0,01
4,350 % fällig am 25.11.2034		8.388		8.025	0,01
4,380 % fällig am 25.01.2035		2.085		1.646	0,00
4,473 % fällig am 25.07.2036		4.624		4.133	0,01
5,115 % fällig am 25.10.2035		1.250		1.072	0,00
5,290 % fällig am 25.06.2035		13.401		11.677	0,02
5,290 % fällig am 25.05.2037		5.991		5.522	0,01
5,290 % fällig am 25.06.2037		12.534		11.569	0,02
5,290 % fällig am 25.07.2037 ^		627		617	0,00
5,290 % fällig am 25.07.2037		3.051		2.772	0,01
5,290 % fällig am 25.08.2037		92		91	0,00
5,290 % fällig am 25.08.2037 ^		1.931		1.699	0,00
5,290 % fällig am 25.04.2047		2.180		2.075	0,00
5,290 % fällig am 25.06.2047 ^		1.370		1.221	0,00
5,290 % fällig am 25.06.2047		1.153		1.060	0,00
5,300 % fällig am 25.04.2047 ^		87		85	0,00
5,320 % fällig am 25.06.2047		16.333		15.549	0,02
5,330 % fällig am 25.06.2047		470		439	0,00
5,330 % fällig am 25.11.2047 ^		1.816		2.004	0,00
5,340 % fällig am 25.11.2037		8.528		7.839	0,01
5,348 % fällig am 25.02.2036		7.000		5.925	0,01
5,350 % fällig am 25.06.2047 ^		9.966		8.625	0,01
5,360 % fällig am 25.05.2047 ^		6.632		5.769	0,01
5,370 % fällig am 25.05.2037		6.436		6.114	0,01
5,370 % fällig am 25.08.2037		15.067		13.091	0,02
5,370 % fällig am 25.09.2037 ^		9.518		9.547	0,02
5,370 % fällig am 25.06.2047		11.617		11.038	0,02
5,370 % fällig am 25.06.2047 ^		10.690		9.661	0,02
5,380 % fällig am 25.05.2037		9.305		8.634	0,01
5,380 % fällig am 25.07.2037 ^		18.023		15.027	0,02
5,380 % fällig am 25.10.2047		5.296		5.195	0,01
5,400 % fällig am 25.06.2047		11.973		11.506	0,02
5,410 % fällig am 25.12.2036 ^		7.794		6.982	0,01
5,410 % fällig am 25.04.2046		843		776	0,00
5,410 % fällig am 25.06.2047		6.724		5.256	0,01
5,410 % fällig am 25.06.2047 ^		5.544		4.366	0,01
5,430 % fällig am 25.02.2037		518		489	0,00
5,505 % fällig am 25.07.2035		442		399	0,00
5,555 % fällig am 25.07.2035		3.535		3.119	0,01
5,585 % fällig am 25.01.2045 ^		2.700		2.402	0,00
5,610 % fällig am 25.05.2037		3.190		3.002	0,01
5,630 % fällig am 25.02.2037		9.514		9.154	0,01
5,630 % fällig am 25.03.2037		14.686		13.781	0,02
5,630 % fällig am 25.03.2047 ^		6.950		6.062	0,01
5,633 % fällig am 25.06.2035		5.026		4.278	0,01
5,650 % fällig am 25.04.2046 ^		5.164		4.942	0,01
5,670 % fällig am 25.09.2046		16.343		15.534	0,02
5,670 % fällig am 25.09.2046 ^		2.556		2.407	0,00
5,675 % fällig am 25.08.2036		4.064		3.873	0,01
5,705 % fällig am 25.07.2036		2.908		2.616	0,00
5,735 % fällig am 25.04.2036		1.000		899	0,00
5,735 % fällig am 25.06.2036 ^		3.260		3.083	0,01
5,750 % fällig am 25.06.2036		1.229		1.217	0,00
5,805 % fällig am 25.04.2036 ^		450		395	0,00
5,840 % fällig am 25.04.2036		16.089		15.515	0,02
5,850 % fällig am 25.03.2036 ^		5.849		5.048	0,01
5,855 % fällig am 25.09.2035		1.497		1.408	0,00
5,870 % fällig am 25.08.2035		1.794		1.583	0,00
5,971 % fällig am 25.09.2046 ^		682		687	0,00
5,989 % fällig am 25.10.2046 ^		55		52	0,00
5,990 % fällig am 25.10.2047		1.100		1.045	0,00
6,050 % fällig am 25.02.2036 ^		4.162		3.881	0,01
6,050 % fällig am 25.05.2036		218		210	0,00
6,125 % fällig am 25.12.2035		891		875	0,00
6,125 % fällig am 25.01.2036		6.110		5.919	0,01
6,140 % fällig am 25.02.2036 ^		4.000		3.482	0,01
6,155 % fällig am 25.10.2035		4.175		4.102	0,01
6,215 % fällig am 25.07.2035		2.979		2.942	0,01
6,215 % fällig am 25.08.2035		1.627		1.621	0,00
6,215 % fällig am 25.10.2035		7.500		7.045	0,01
6,230 % fällig am 25.05.2036		13.306		9.037	0,01
6,245 % fällig am 25.07.2035		129		128	0,00
6,245 % fällig am 25.04.2036 ^		3.700		3.477	0,01
6,275 % fällig am 25.11.2035		300		291	0,00
6,290 % fällig am 25.01.2036		3.000		2.829	0,01
6,350 % fällig am 25.11.2035 ^		7.978		7.277	0,01
6,650 % fällig am 25.10.2034		518		509	0,00
6,770 % fällig am 25.10.2046 ^		6.945		4.842	0,01
6,800 % fällig am 25.06.2035		2.077		2.031	0,00

BESCHREIBUNG		PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
7,100 % fällig am 25.08.2035	$	4.950	$ 4.617	0,01
7,250 % fällig am 25.08.2035		604	452	0,00
7,550 % fällig am 25.10.2034		534	502	0,00
Countrywide Asset-Backed Certificates Trust, Inc.				
5,650 % fällig am 25.10.2034		3.201	3.052	0,01
5,690 % fällig am 25.12.2034		5.112	4.941	0,01
5,870 % fällig am 25.07.2034		571	563	0,00
6,005 % fällig am 25.08.2034		555	552	0,00
Countrywide Asset-Backed Certificates, Inc.				
5,171 % fällig am 25.03.2035		5.537	5.356	0,01
5,890 % fällig am 25.08.2047		13.062	12.430	0,02
5,900 % fällig am 25.03.2034		2.775	2.703	0,00
6,650 % fällig am 25.02.2035		5.912	5.780	0,01
Countrywide Asset-Backed Securities Notes Trust				
7,150 % fällig am 25.08.2047		112	109	0,00
Countrywide Revolving Home Equity Loan Trust				
5,373 % fällig am 15.05.2036		725	710	0,00
5,393 % fällig am 15.05.2036		693	657	0,00
Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp.				
6,500 % fällig am 25.05.2044		23	23	0,00
Credit-Based Asset Servicing & Securitization CBO Ltd.				
5,588 % fällig am 16.02.2041		54.641	853	0,00
Credit-Based Asset Servicing & Securitization LLC				
2,817 % fällig am 25.05.2036		3.598	2.366	0,00
3,044 % fällig am 25.12.2036 ^		4.239	3.375	0,01
3,208 % fällig am 25.12.2035		365	349	0,00
3,289 % fällig am 25.03.2034		341	340	0,00
3,506 % fällig am 25.04.2037		5.575	3.453	0,01
4,727 % fällig am 25.12.2037		680	729	0,00
5,450 % fällig am 25.10.2036		2.963	2.453	0,00
8,525 % fällig am 25.01.2033 ^		286	246	0,00
Credit-Based Asset Servicing & Securitization Mortgage Loan Trust				
3,287 % fällig am 25.03.2037 ^		110	42	0,00
3,535 % fällig am 25.02.2037 ^		699	428	0,00
Credit-Based Asset Servicing & Securitization Trust				
3,075 % fällig am 25.07.2036		2.139	1.993	0,00
3,156 % fällig am 25.01.2037 ^		4.142	1.296	0,00
5,370 % fällig am 25.11.2036		10.391	4.885	0,01
5,450 % fällig am 25.11.2036		2.439	1.146	0,00
5,610 % fällig am 25.11.2036		846	397	0,00
5,630 % fällig am 25.10.2036		9.908	6.612	0,01
CSAB Mortgage-Backed Trust				
5,610 % fällig am 25.11.2036		7.941	1.166	0,00
5,858 % fällig am 25.05.2037		5.422	1.387	0,00
5,898 % fällig am 25.05.2037 ^		815	209	0,00
6,580 % fällig am 25.09.2036		2.145	724	0,00
CVC Cordatus Loan Fund DAC				
3,855 % fällig am 21.07.2030	€	37.050	39.755	0,06
4,411 % fällig am 23.10.2034		10.600	11.418	0,02
4,423 % fällig am 20.08.2034		5.000	5.319	0,01
Dryden CLO Ltd.				
6,232 % fällig am 18.04.2031	$	6.600	6.537	0,01
6,380 % fällig am 15.01.2031		3.731	3.702	0,01
Dryden Euro CLO BV				
3,927 % fällig am 15.07.2032	€	935	1.004	0,00
Dryden Euro CLO DAC				
3,987 % fällig am 15.01.2032		3.265	3.509	0,01
4,057 % fällig am 15.04.2034		3.000	3.176	0,01
Dryden Senior Loan Fund				
6,230 % fällig am 15.04.2031	$	22.350	22.173	0,04
ECMC Group Student Loan Trust				
6,200 % fällig am 25.05.2067		15.461	15.020	0,02
EFS Volunteer LLC				
6,105 % fällig am 25.10.2035		629	628	0,00
Ellington Loan Acquisition Trust				
6,200 % fällig am 25.05.2037		9.878	9.289	0,02
6,250 % fällig am 25.05.2037		13.011	12.565	0,02
6,650 % fällig am 25.05.2037		1.529	1.487	0,00
Encore Credit Receivables Trust				
5,885 % fällig am 25.07.2035		1.899	1.722	0,00
6,050 % fällig am 25.01.2036		828	780	0,00
6,080 % fällig am 25.11.2035		4.103	3.711	0,01
6,125 % fällig am 25.01.2036		4.142	3.616	0,01
6,170 % fällig am 25.07.2035		2.138	1.870	0,00
EquiFirst Loan Securitization Trust				
5,320 % fällig am 25.04.2037		1.718	1.537	0,00
EquiFirst Mortgage Loan Trust				
6,950 % fällig am 25.04.2035		1.091	910	0,00

BESCHREIBUNG		PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
7,775 % fällig am 25.12.2034	$	657	$ 569	0,00
8,525 % fällig am 25.10.2034		1.104	1.003	0,00
FAB CBO BV				
4,192 % fällig am 20.08.2080	€	321	351	0,00
FBR Securitization Trust				
5,885 % fällig am 25.11.2035	$	11.731	10.625	0,02
Fidelity Grand Harbour CLO DAC				
4,726 % fällig am 15.03.2032	€	5.196	5.572	0,01
Fieldstone Mortgage Investment Trust				
5,378 % fällig am 25.11.2036	$	3.292	1.916	0,00
5,418 % fällig am 25.11.2036		7.752	6.890	0,01
5,530 % fällig am 25.05.2036		6.983	4.801	0,01
5,618 % fällig am 25.11.2036		2.631	1.531	0,00
5,795 % fällig am 25.02.2036		10.407	9.224	0,02
7,175 % fällig am 25.02.2035		1.063	1.008	0,00
Finance America Mortgage Loan Trust				
6,095 % fällig am 25.11.2034		629	552	0,00
6,170 % fällig am 25.11.2034		459	382	0,00
First Franklin Mortgage Loan Trust				
4,234 % fällig am 25.03.2036		1.697	1.682	0,00
5,250 % fällig am 25.03.2037		5.063	2.450	0,00
5,260 % fällig am 25.12.2037		557	523	0,00
5,270 % fällig am 25.11.2036		7.226	6.667	0,01
5,270 % fällig am 25.12.2036		7.825	7.262	0,01
5,300 % fällig am 25.03.2037		638	310	0,00
5,310 % fällig am 25.10.2036		4.759	4.672	0,01
5,310 % fällig am 25.11.2036		8.365	8.224	0,01
5,310 % fällig am 25.12.2037		8.064	6.949	0,01
5,360 % fällig am 25.12.2037		11.910	10.288	0,02
5,430 % fällig am 25.12.2036		13.847	5.882	0,01
5,450 % fällig am 25.08.2036		1.118	1.018	0,00
5,460 % fällig am 25.07.2036		3.734	3.528	0,01
5,460 % fällig am 25.09.2036		5.624	5.187	0,01
5,470 % fällig am 25.04.2036		6.254	5.981	0,01
5,470 % fällig am 25.06.2036		5.489	5.313	0,01
5,630 % fällig am 25.08.2036		7.295	6.694	0,01
5,630 % fällig am 25.10.2036		13.539	9.151	0,01
5,750 % fällig am 25.02.2036		4.037	3.645	0,01
5,825 % fällig am 25.11.2035		1.347	1.311	0,00
5,840 % fällig am 25.01.2036		3.122	2.820	0,01
5,855 % fällig am 25.05.2036		176	175	0,00
5,870 % fällig am 25.08.2034		880	826	0,00
5,870 % fällig am 25.10.2035		26	26	0,00
5,870 % fällig am 25.11.2035		2.481	2.285	0,00
5,900 % fällig am 25.12.2035		4.060	3.860	0,01
5,975 % fällig am 25.06.2034		350	349	0,00
6,050 % fällig am 25.07.2035		1.150	1.125	0,00
6,080 % fällig am 25.07.2034		143	142	0,00
6,095 % fällig am 25.03.2035		754	736	0,00
6,095 % fällig am 25.09.2035		4.706	4.117	0,01
6,425 % fällig am 25.07.2034		1.461	1.421	0,00
6,575 % fällig am 25.10.2034		406	404	0,00
6,950 % fällig am 25.09.2034		1.708	1.716	0,00
First NLC Trust				
5,220 % fällig am 25.08.2037		6.157	3.156	0,01
5,290 % fällig am 25.08.2037		185	95	0,00
5,330 % fällig am 25.08.2037		3.340	1.712	0,00
5,430 % fällig am 25.08.2037		46	24	0,00
5,885 % fällig am 25.02.2036		4.467	3.669	0,01
Fremont Home Loan Trust				
5,280 % fällig am 25.11.2036		5.288	1.920	0,00
5,285 % fällig am 25.10.2036		11.907	10.487	0,02
5,290 % fällig am 25.01.2037		21.477	10.919	0,02
5,300 % fällig am 25.10.2036		12.540	5.120	0,01
5,350 % fällig am 25.08.2036		6.764	2.269	0,00
5,370 % fällig am 25.11.2036		6.678	2.424	0,00
5,430 % fällig am 25.02.2037		13.354	10.290	0,02
5,470 % fällig am 25.05.2036		8.754	5.176	0,01
5,490 % fällig am 25.02.2036		4.076	3.857	0,01
5,690 % fällig am 25.02.2036		300	255	0,00
5,765 % fällig am 25.11.2035		5.829	5.016	0,01
5,810 % fällig am 25.01.2036		1.390	1.291	0,00
5,825 % fällig am 25.01.2036		6.546	4.821	0,01
5,830 % fällig am 25.11.2035		296	289	0,00
5,900 % fällig am 25.06.2035		1.133	1.101	0,00
5,930 % fällig am 25.07.2035		2.012	1.893	0,00
6,020 % fällig am 25.05.2034		757	700	0,00
6,080 % fällig am 25.07.2035		2.103	1.621	0,00
6,170 % fällig am 25.01.2035		3.126	2.678	0,00
6,200 % fällig am 25.11.2034		1.642	1.535	0,00
6,215 % fällig am 25.06.2035		4.314	4.087	0,01
6,905 % fällig am 25.05.2034 ^		23	27	0,00

BESCHREIBUNG		PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
Galaxy CLO Ltd.				
6,338 % fällig am 16.05.2031	$	4.425	$ 4.372	0,01
GE-WMC Asset-Backed Pass-Through Certificates				
5,790 % fällig am 25.12.2035		1.322	1.247	0,00
5,810 % fällig am 25.10.2035		1.334	1.284	0,00
5,810 % fällig am 25.12.2035		1.696	1.319	0,00
GE-WMC Mortgage Securities Trust				
5,410 % fällig am 25.08.2036		6.664	6.138	0,01
GoldenTree Loan Management EUR CLO DAC				
3,930 % fällig am 20.10.2030	€	966	1.036	0,00
Goodgreen Trust				
3,930 % fällig am 15.10.2053	$	11.219	9.994	0,02
Greystone Commercial Real Estate Notes Ltd.				
6,373 % fällig am 15.09.2037		22.512	22.211	0,04
GSAA Home Equity Trust				
5,250 % fällig am 25.09.2036		4.071	977	0,00
5,250 % fällig am 25.12.2046		2.438	1.225	0,00
5,270 % fällig am 25.05.2036		6.561	1.645	0,00
5,270 % fällig am 25.11.2036		5.050	1.276	0,00
5,290 % fällig am 25.12.2046		7.011	2.089	0,00
5,310 % fällig am 25.02.2037		6.044	1.876	0,00
5,330 % fällig am 25.07.2036		1.323	295	0,00
5,350 % fällig am 25.03.2037		8.029	2.456	0,00
5,470 % fällig am 25.06.2036		4.375	970	0,00
5,490 % fällig am 25.09.2036		5.540	1.340	0,00
5,490 % fällig am 25.03.2047		19.536	6.041	0,01
5,510 % fällig am 25.03.2036		11.701	4.487	0,01
5,510 % fällig am 25.12.2036		13.161	3.741	0,01
5,530 % fällig am 25.03.2036		8.320	3.048	0,01
5,558 % fällig am 25.05.2035		314	289	0,00
5,630 % fällig am 25.11.2036		7.394	2.612	0,00
5,676 % fällig am 25.09.2035		3.303	2.261	0,00
5,750 % fällig am 25.03.2036		3.340	1.825	0,00
5,750 % fällig am 25.05.2047		112	75	0,00
5,788 % fällig am 25.05.2037 ^		5.899	2.631	0,00
5,870 % fällig am 25.10.2035		2.104	1.836	0,00
5,885 % fällig am 25.06.2035		2.200	2.118	0,00
5,910 % fällig am 25.01.2036		465	40	0,00
5,917 % fällig am 25.03.2037 ^		2.327	483	0,00
6,000 % fällig am 25.10.2037 ^		111	96	0,00
6,095 % fällig am 25.08.2035		2.004	1.794	0,00
6,300 % fällig am 25.03.2037 ^		5.665	1.413	0,00
6,376 % fällig am 25.09.2036		716	196	0,00
6,459 % fällig am 25.09.2036 ^		4.796	1.313	0,00
6,483 % fällig am 25.03.2037 ^		5.301	1.610	0,00
6,500 % fällig am 25.10.2037		1.133	597	0,00
6,599 % fällig am 25.03.2037		2.097	521	0,00
GSAMP Trust				
3,332 % fällig am 25.11.2034		1.345	1.268	0,00
5,200 % fällig am 25.12.2046		305	153	0,00
5,250 % fällig am 25.12.2046		1.369	689	0,00
5,270 % fällig am 25.12.2036		4.932	2.420	0,00
5,280 % fällig am 25.12.2046		5.250	2.858	0,01
5,290 % fällig am 25.11.2036		4.861	2.317	0,00
5,290 % fällig am 25.03.2047		6.201	5.533	0,01
5,300 % fällig am 25.12.2046		462	233	0,00
5,310 % fällig am 25.08.2036		2.211	1.752	0,00
5,310 % fällig am 25.01.2037		15.493	9.071	0,01
5,320 % fällig am 25.12.2036		7.221	3.542	0,01
5,320 % fällig am 25.01.2037		4.875	4.685	0,01
5,350 % fällig am 25.11.2036		1.187	575	0,00
5,380 % fällig am 25.12.2046		681	343	0,00
5,390 % fällig am 25.09.2036		17.913	6.522	0,01
5,420 % fällig am 25.03.2047		5.838	5.391	0,01
5,430 % fällig am 25.06.2036		1.998	1.933	0,00
5,450 % fällig am 25.06.2036		6.161	3.380	0,01
5,450 % fällig am 25.08.2036		1.411	1.379	0,00
5,450 % fällig am 25.12.2036		1.246	1.180	0,00
5,470 % fällig am 25.04.2036		4.840	3.021	0,01
5,520 % fällig am 25.03.2047		3.302	2.477	0,00
5,525 % fällig am 25.10.2046		6.000	4.898	0,01
5,630 % fällig am 25.06.2036		2.088	1.113	0,00
5,630 % fällig am 25.03.2046		235	227	0,00
5,670 % fällig am 25.02.2046		749	688	0,00
5,690 % fällig am 25.02.2036		91	85	0,00
5,735 % fällig am 25.01.2036		583	593	0,00
5,750 % fällig am 25.01.2047		3.106	1.684	0,00
5,765 % fällig am 25.01.2036		2.504	2.171	0,00
5,795 % fällig am 25.11.2035 ^		4.309	3.754	0,01
6,035 % fällig am 25.07.2045 ^		5.659	4.834	0,01
6,050 % fällig am 25.11.2035 ^		4.239	3.967	0,01

BESCHREIBUNG		PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
6,125 % fällig am 25.03.2035 ^	$	1.053	$ 938	0,00
6,125 % fällig am 25.04.2035 ^		2.010	1.832	0,00
6,200 % fällig am 25.06.2034		455	420	0,00
8,525 % fällig am 25.02.2047		1.500	1.415	0,00
Harvest CLO DAC				
4,027 % fällig am 15.01.2032	€	23.100	24.662	0,04
Hildene TruPS Financials Note Securitization Ltd.				
6,571 % fällig am 10.10.2038	$	22.725	20.623	0,03
Home Equity Asset Trust				
3,883 % fällig am 25.02.2036		3.525	3.388	0,01
5,450 % fällig am 25.11.2036		1.451	1.404	0,00
5,630 % fällig am 25.10.2036		4.431	2.721	0,00
5,750 % fällig am 25.07.2036		3.250	2.950	0,01
5,810 % fällig am 25.04.2036		2.529	2.211	0,00
5,855 % fällig am 25.01.2036		2.812	2.658	0,00
5,945 % fällig am 25.11.2035		622	614	0,00
5,990 % fällig am 25.01.2035		782	757	0,00
6,050 % fällig am 25.12.2034		89	87	0,00
6,095 % fällig am 25.11.2035		523	491	0,00
6,095 % fällig am 25.12.2035		620	568	0,00
6,395 % fällig am 25.05.2035		1.048	974	0,00
6,650 % fällig am 25.03.2035		867	811	0,00
6,800 % fällig am 25.12.2034		575	555	0,00
6,850 % fällig am 25.11.2034		383	373	0,00
6,900 % fällig am 25.11.2034		297	287	0,00
Home Equity Loan Trust				
5,380 % fällig am 25.04.2037		415	401	0,00
Home Equity Mortgage Loan Asset-Backed Trust				
5,270 % fällig am 25.04.2037		5.756	3.977	0,01
5,290 % fällig am 25.11.2036		5.360	4.817	0,01
5,310 % fällig am 25.11.2036		3.721	3.168	0,01
5,320 % fällig am 25.04.2037		10.193	7.043	0,01
5,340 % fällig am 25.04.2037		9.601	6.265	0,01
5,340 % fällig am 25.07.2037		7.953	3.245	0,01
5,350 % fällig am 25.07.2037		9.272	4.976	0,01
5,360 % fällig am 25.04.2037		1.239	856	0,00
5,390 % fällig am 25.11.2036		602	449	0,00
5,390 % fällig am 25.04.2037		10.445	6.817	0,01
5,510 % fällig am 25.06.2036		2.909	2.717	0,00
5,530 % fällig am 25.06.2036		45	45	0,00
5,630 % fällig am 25.08.2036		5.732	5.022	0,01
5,810 % fällig am 25.03.2036		4.756	4.380	0,01
6,215 % fällig am 25.08.2035		1.800	1.672	0,00
6,395 % fällig am 25.03.2035		2.936	2.841	0,01
HSI Asset Securitization Corp. Trust				
5,300 % fällig am 25.12.2036		2.570	2.270	0,00
5,340 % fällig am 25.01.2037		13.232	9.151	0,01
5,370 % fällig am 25.12.2036		16.449	7.093	0,01
5,410 % fällig am 25.04.2037		11.818	6.056	0,01
5,470 % fällig am 25.10.2036		18.526	7.530	0,01
5,525 % fällig am 25.05.2037		4.026	3.860	0,01
5,590 % fällig am 25.12.2036		17.797	4.806	0,01
5,675 % fällig am 25.02.2036		3.065	2.614	0,00
5,690 % fällig am 25.12.2035		490	484	0,00
5,735 % fällig am 25.12.2035		3.500	3.229	0,01
5,765 % fällig am 25.01.2036		8.126	7.409	0,01
Humboldt Americas LLC				
0,000 % fällig am 31.07.2022		20.000.00		
	COP	0	4.722	0,01
ICG Euro CLO DAC				
2,150 % fällig am 15.10.2034	€	6.000	5.360	0,01
IndyMac Manufactured Housing Contract Pass-Through Certificates				
6,750 % fällig am 25.02.2028	$	5	5	0,00
IXIS Real Estate Capital Trust				
5,210 % fällig am 25.05.2037		21.378	5.359	0,01
5,450 % fällig am 25.01.2037		13.909	5.056	0,01
5,470 % fällig am 25.08.2036		3.218	950	0,00
5,550 % fällig am 25.03.2036 ^		1.409	729	0,00
JPMorgan Mortgage Acquisition Corp.				
2,810 % fällig am 25.10.2035 ^		366	356	0,00
2,810 % fällig am 25.10.2035		3.847	3.304	0,01
5,660 % fällig am 25.02.2036 ^		2.412	2.339	0,00
5,690 % fällig am 25.02.2036 ^		2.711	2.343	0,00
5,690 % fällig am 25.03.2036		6.125	5.683	0,01
5,780 % fällig am 25.05.2035 ^	$	5.614	$ 5.072	0,01
5,855 % fällig am 25.09.2035		155	153	0,00
5,900 % fällig am 25.06.2035		4.606	4.465	0,01
JPMorgan Mortgage Acquisition Trust				
3,815 % fällig am 25.07.2036		2.124	2.074	0,00

BESCHREIBUNG		PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
3,967 % fällig am 25.11.2036		4.292	3.695	0,01
4,193 % fällig am 25.11.2036		5.889	5.817	0,01
4,459 % fällig am 25.01.2037 ^		2.578	1.412	0,00
5,230 % fällig am 25.12.2036		3.087	1.622	0,00
5,300 % fällig am 25.12.2036		5.641	2.982	0,01
5,330 % fällig am 25.07.2036		511	228	0,00
5,340 % fällig am 25.03.2047		1.692	1.673	0,00
5,360 % fällig am 25.10.2036		4.004	3.941	0,01
5,360 % fällig am 25.12.2036		5.642	2.996	0,01
5,380 % fällig am 25.05.2037		2.290	2.198	0,00
5,390 % fällig am 25.05.2037		7.378	7.315	0,01
5,410 % fällig am 25.03.2037		2.852	2.769	0,01
5,410 % fällig am 25.06.2037		2.020	2.010	0,00
5,420 % fällig am 25.08.2036		6.700	5.965	0,01
5,440 % fällig am 25.07.2036		436	423	0,00
5,450 % fällig am 25.01.2037		537	512	0,00
5,450 % fällig am 25.03.2037		7.847	7.049	0,01
5,530 % fällig am 25.07.2036		1.800	1.721	0,00
5,555 % fällig am 25.05.2036		2.406	2.333	0,00
5,555 % fällig am 25.07.2036		3.001	2.908	0,01
5,585 % fällig am 25.05.2036		5.026	4.713	0,01
5,590 % fällig am 25.07.2036		1.998	1.788	0,00
5,600 % fällig am 25.07.2036		3.786	3.174	0,01
5,660 % fällig am 25.04.2036		5.628	4.381	0,01
5,680 % fällig am 25.01.2037		5.706	4.929	0,01
6,630 % fällig am 25.07.2036 ^		9.952	2.927	0,01
Kodiak CDO Ltd.				
5,324 % fällig am 07.08.2037		3.242	3.088	0,01
LCM Loan Income Fund Income Note Issuer Ltd.				
6,340 % fällig am 16.07.2031		12.648	12.479	0,02
LCM LP				
6,270 % fällig am 20.04.2031		50.000	49.467	0,08
Lehman ABS Manufactured Housing Contract Trust				
6,630 % fällig am 15.04.2040		2.811	2.756	0,01
Lehman XS Trust				
4,106 % fällig am 25.06.2036		6	6	0,00
5,058 % fällig am 25.01.2036 ^		2.078	1.930	0,00
5,350 % fällig am 25.02.2037		10.121	9.004	0,01
5,460 % fällig am 25.03.2037		2.385	2.096	0,00
5,470 % fällig am 25.05.2036		3.177	2.738	0,00
5,490 % fällig am 25.10.2036		1.710	1.553	0,00
5,490 % fällig am 25.12.2036		3.959	3.687	0,01
5,570 % fällig am 25.06.2046		4.463	4.083	0,01
5,610 % fällig am 25.02.2037		5.430	4.072	0,01
5,670 % fällig am 25.05.2046 ^		1.560	1.393	0,00
5,670 % fällig am 25.02.2047		2.034	1.825	0,00
5,730 % fällig am 25.09.2036		3.532	3.071	0,01
6,260 % fällig am 25.11.2035		2.737	1.270	0,00
6,390 % fällig am 25.04.2036 ^		28	37	0,00
6,790 % fällig am 24.06.2046		222	279	0,00
7,450 % fällig am 25.12.2037		982	995	0,00
Long Beach Mortgage Loan Trust				
5,310 % fällig am 25.12.2036		23.063	15.816	0,03
5,320 % fällig am 25.12.2036		85	31	0,00
5,330 % fällig am 25.09.2036		13.442	3.774	0,01
5,350 % fällig am 25.07.2036		6.297	2.548	0,00
5,370 % fällig am 25.11.2036		328	104	0,00
5,380 % fällig am 25.12.2036		1.412	517	0,00
5,390 % fällig am 25.08.2036		19.494	8.043	0,01
5,440 % fällig am 25.07.2036		4.984	3.604	0,01
5,450 % fällig am 25.05.2036		9.643	5.609	0,01
5,450 % fällig am 25.07.2036		2.449	994	0,00
5,450 % fällig am 25.09.2036		801	510	0,00
5,450 % fällig am 25.11.2036		15.462	11.143	0,02
5,470 % fällig am 25.05.2036		11.255	3.605	0,01
5,470 % fällig am 25.08.2036		2.476	1.025	0,00
5,470 % fällig am 25.09.2036		10.454	2.945	0,01
5,470 % fällig am 25.10.2036		28.699	8.926	0,01
5,470 % fällig am 25.05.2046		12.744	11.558	0,02
5,510 % fällig am 25.03.2046		20.253	16.608	0,03
5,530 % fällig am 25.03.2046		2.709	985	0,00
5,630 % fällig am 25.08.2036		3.052	1.270	0,00
5,670 % fällig am 25.08.2045		548	525	0,00
5,710 % fällig am 25.10.2034		4.254	3.955	0,01
5,750 % fällig am 25.01.2036		12.401	11.247	0,02
5,750 % fällig am 25.02.2036		11.881	9.772	0,02
5,930 % fällig am 25.08.2035		7.590	7.360	0,01
5,945 % fällig am 25.06.2034	$	2.301	$ 2.227	0,00
6,200 % fällig am 25.06.2035		5.082	4.919	0,01
6,275 % fällig am 25.04.2035		2.500	2.347	0,00

BESCHREIBUNG		PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
6,300 % fällig am 25.09.2034		1.384	1.353	0,00
6,575 % fällig am 25.02.2035		6.916	6.180	0,01
Madison Park Funding Ltd.				
0,000 % fällig am 29.07.2030		12.337	12.296	0,02
Man GLG Euro CLO DAC				
3,857 % fällig am 15.10.2030	€	7.694	8.242	0,01
3,917 % fällig am 15.10.2030		12.650	13.522	0,02
3,987 % fällig am 15.10.2032		7.492	7.962	0,01
4,047 % fällig am 15.01.2030		10.991	11.844	0,02
MAPS Ltd.				
4,212 % fällig am 15.05.2043	$	19.381	17.313	0,03
Marlay Park CLO DAC				
3,917 % fällig am 15.10.2030	€	3.021	3.246	0,01
MASTR Asset-Backed Securities Trust				
5,200 % fällig am 25.10.2036	$	4.037	1.313	0,00
5,250 % fällig am 25.11.2036		103	33	0,00
5,295 % fällig am 25.01.2037		22.242	6.401	0,01
5,300 % fällig am 25.10.2036		6.870	2.254	0,00
5,320 % fällig am 25.10.2036		45	44	0,00
5,350 % fällig am 25.08.2036		8.389	3.067	0,01
5,350 % fällig am 25.10.2036		5.455	2.758	0,00
5,360 % fällig am 25.05.2037		6.697	6.309	0,01
5,410 % fällig am 25.10.2036		513	238	0,00
5,420 % fällig am 25.08.2036		7.491	3.054	0,01
5,450 % fällig am 25.04.2036		2.139	546	0,00
5,450 % fällig am 25.06.2036		3.564	1.350	0,00
5,450 % fällig am 25.08.2036		14.185	5.200	0,01
5,470 % fällig am 25.10.2036		7.141	3.610	0,01
5,590 % fällig am 25.11.2036		9.446	5.624	0,01
5,630 % fällig am 25.03.2036		3.052	1.876	0,00
5,630 % fällig am 25.08.2036		4.067	1.507	0,00
5,650 % fällig am 25.10.2035 ^		4.757	4.444	0,01
5,650 % fällig am 25.11.2035		2.634	1.524	0,00
5,720 % fällig am 25.01.2036		2.386	2.327	0,00
5,730 % fällig am 25.01.2036		613	599	0,00
5,850 % fällig am 25.09.2034		2.100	1.780	0,00
5,975 % fällig am 25.10.2034		100	95	0,00
6,155 % fällig am 25.03.2035		2.260	2.194	0,00
6,300 % fällig am 25.08.2037		6.658	5.529	0,01
6,875 % fällig am 25.06.2035		100	99	0,00
7,685 % fällig am 25.06.2035		1.659	1.639	0,00
MASTR Specialized Loan Trust				
5,520 % fällig am 25.01.2037		3.949	1.605	0,00
5,670 % fällig am 25.06.2046		1.456	1.385	0,00
6,523 % fällig am 25.07.2035		451	426	0,00
Merrill Lynch First Franklin Mortgage Loan Trust				
5,430 % fällig am 25.04.2037		658	298	0,00
5,510 % fällig am 25.06.2037		674	520	0,00
6,150 % fällig am 25.10.2037		7.010	5.800	0,01
Merrill Lynch Mortgage Investors Trust				
5,370 % fällig am 25.07.2037		6.166	2.729	0,00
5,390 % fällig am 25.02.2037		3.990	1.201	0,00
5,430 % fällig am 25.05.2037		5.219	2.766	0,00
5,430 % fällig am 25.11.2037		7.977	4.123	0,01
5,450 % fällig am 25.06.2037		3.619	932	0,00
5,450 % fällig am 25.08.2037		14.610	10.082	0,02
5,450 % fällig am 25.11.2037		3.560	1.251	0,00
5,470 % fällig am 25.03.2037		10.778	9.454	0,02
5,470 % fällig am 25.07.2037		3.013	1.741	0,00
5,530 % fällig am 25.04.2047		6.340	2.642	0,00
5,650 % fällig am 25.07.2037		3.456	838	0,00
5,670 % fällig am 25.03.2037		2.645	757	0,00
5,670 % fällig am 25.07.2037		5.386	2.417	0,00
5,750 % fällig am 25.12.2036		2.621	2.454	0,00
5,750 % fällig am 25.01.2037		5.374	4.847	0,01
6,050 % fällig am 25.02.2047		210	124	0,00
6,080 % fällig am 25.07.2035		1.360	1.315	0,00
6,230 % fällig am 25.10.2035		146	143	0,00
6,275 % fällig am 25.08.2036		3.078	3.099	0,01
MESA Trust				
5,950 % fällig am 25.12.2031		3	3	0,00
METAL Cayman Ltd.				
4,581 % fällig am 15.10.2042		26.857	16.357	0,03
MMcapS Funding Ltd.				
5,846 % fällig am 01.12.2035		2.955	2.807	0,01
Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust				
3,580 % fällig am 25.01.2035		1.950	1.687	0,00
5,220 % fällig am 25.10.2036		2.870	1.511	0,00

BESCHREIBUNG		PAR (000S)		MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
5,240 % fällig am 25.01.2037	$	16.118	$	7.388	0,01
5,250 % fällig am 25.07.2036		6.504		2.472	0,00
5,250 % fällig am 25.10.2036		1.365		594	0,00
5,260 % fällig am 25.10.2036		5.144		2.713	0,00
5,260 % fällig am 25.12.2036		3.704		1.842	0,00
5,260 % fällig am 25.02.2037		3.273		1.045	0,00
5,260 % fällig am 25.03.2037		426		188	0,00
5,280 % fällig am 25.02.2037		74		67	0,00
5,290 % fällig am 25.10.2036		14.055		6.114	0,01
5,290 % fällig am 25.05.2037		24.074		19.204	0,03
5,300 % fällig am 25.11.2036		7.057		3.887	0,01
5,300 % fällig am 25.12.2036		10.953		5.448	0,01
5,300 % fällig am 25.02.2037		4.883		2.359	0,00
5,330 % fällig am 25.02.2037		632		202	0,00
5,350 % fällig am 25.05.2037		6.949		3.847	0,01
5,360 % fällig am 25.01.2037		5.138		2.359	0,00
5,400 % fällig am 25.07.2036		8.168		7.041	0,01
5,400 % fällig am 25.12.2036		0		0	0,00
5,400 % fällig am 25.03.2037		2.196		970	0,00
5,410 % fällig am 25.02.2037		844		408	0,00
5,450 % fällig am 25.06.2036		3.709		1.942	0,00
5,450 % fällig am 25.07.2036		3.443		1.320	0,00
5,470 % fällig am 25.09.2036		3.820		1.709	0,00
5,480 % fällig am 25.02.2037		12.765		6.169	0,01
5,630 % fällig am 25.06.2036		23.262		16.090	0,03
5,630 % fällig am 25.09.2036		24.633		9.298	0,02
5,645 % fällig am 25.03.2036		6.831		5.759	0,01
5,650 % fällig am 25.04.2036		8.935		8.253	0,01
5,650 % fällig am 25.07.2036		1.634		631	0,00
5,720 % fällig am 25.12.2035		6.235		5.005	0,01
5,720 % fällig am 25.12.2035		120		115	0,00
5,750 % fällig am 25.12.2035		3.500		3.222	0,01
5,810 % fällig am 25.01.2035		2.782		2.698	0,00
5,810 % fällig am 25.11.2035		6.282		5.993	0,01
5,825 % fällig am 25.12.2034		580		549	0,00
5,825 % fällig am 25.09.2035		4.865		4.515	0,01
5,855 % fällig am 25.12.2034		413		372	0,00
5,890 % fällig am 25.01.2034		1.664		1.617	0,00
5,975 % fällig am 25.08.2034		548		500	0,00
6,050 % fällig am 25.08.2034		1.082		1.031	0,00
6,065 % fällig am 25.07.2034		389		388	0,00
6,065 % fällig am 25.03.2035		326		322	0,00
6,080 % fällig am 25.11.2034		1.242		1.211	0,00
6,080 % fällig am 25.02.2035		2.224		1.980	0,00
6,095 % fällig am 25.01.2035		3.746		3.293	0,01
6,150 % fällig am 25.07.2037		6.450		6.267	0,01
6,170 % fällig am 25.08.2034		4		4	0,00
6,200 % fällig am 25.04.2035		2.170		2.019	0,00
6,200 % fällig am 25.06.2035 ^		3.175		2.851	0,01
6,400 % fällig am 25.07.2037		8.600		7.209	0,01
6,950 % fällig am 25.05.2034		433		404	0,00
7,775 % fällig am 25.03.2034		794		764	0,00
Morgan Stanley Capital, Inc. Trust					
5,690 % fällig am 25.02.2036		3.568		3.139	0,01
5,690 % fällig am 25.03.2036		9.534		7.721	0,01
5,705 % fällig am 25.01.2036		2.869		2.215	0,00
5,730 % fällig am 25.01.2036		1.498		1.434	0,00
5,730 % fällig am 25.02.2036		209		205	0,00
Morgan Stanley Home Equity Loan Trust					
5,320 % fällig am 25.04.2037		16.626		8.722	0,01
5,470 % fällig am 25.04.2036		6.732		4.743	0,01
5,660 % fällig am 25.02.2036		5.534		4.992	0,01
Morgan Stanley IXIS Real Estate Capital Trust					
5,200 % fällig am 25.11.2036		1		0	0,00
5,220 % fällig am 25.11.2036		6.924		2.445	0,00
5,300 % fällig am 25.11.2036		5.693		2.012	0,00
5,370 % fällig am 25.11.2036		1.558		551	0,00
5,450 % fällig am 25.07.2036		13.661		5.566	0,01
Morgan Stanley Mortgage Loan Trust					
5,310 % fällig am 25.11.2036		1.401		438	0,00
5,390 % fällig am 25.04.2037		14.896		4.383	0,01
5,490 % fällig am 25.10.2036		8.126		2.502	0,00
5,490 % fällig am 25.11.2036		4.559		1.420	0,00
5,490 % fällig am 25.01.2047 ^		3.768		1.233	0,00
5,630 % fällig am 25.04.2037		3.572		1.052	0,00
5,690 % fällig am 25.04.2037		15.850		5.800	0,01
5,870 % fällig am 25.04.2037		2.932		863	0,00
6,077 % fällig am 25.10.2046 ^		4.374		1.102	0,00
6,263 % fällig am 25.01.2047		1.249		416	0,00
6,298 % fällig am 25.10.2036 ^		8.857		2.129	0,00
6,326 % fällig am 25.09.2046		11.620		2.790	0,00
6,488 % fällig am 25.11.2036 ^		6.319		1.471	0,00
6,592 % fällig am 25.10.2036		1.826		621	0,00

BESCHREIBUNG		PAR (000S)		MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
Mountain View CLO LLC					
6,350 % fällig am 16.10.2029	$	33.807	$	33.598	0,05
Nassau Ltd.					
6,410 % fällig am 15.10.2029		8.625		8.613	0,01
National Collegiate Student Loan Trust					
5,460 % fällig am 25.05.2032		6.362		6.043	0,01
5,470 % fällig am 27.10.2031		9.809		9.573	0,02
5,500 % fällig am 25.03.2033		8.054		7.548	0,01
5,520 % fällig am 25.06.2033		2.749		2.584	0,00
Nationstar Home Equity Loan Trust					
5,325 % fällig am 25.06.2037		3.019		2.935	0,01
5,470 % fällig am 25.04.2037		7.643		7.468	0,01
Navient Private Education Loan Trust					
2,650 % fällig am 15.12.2028		135		135	0,00
6,643 % fällig am 16.07.2040		12.845		12.826	0,02
7,343 % fällig am 15.12.2045		6.134		6.162	0,01
New Century Home Equity Loan Trust					
5,310 % fällig am 25.08.2036		6.013		5.750	0,01
5,510 % fällig am 25.05.2036		1.162		1.133	0,00
5,795 % fällig am 25.12.2035		7.106		6.708	0,01
5,825 % fällig am 25.03.2035		2.153		2.124	0,00
5,870 % fällig am 25.03.2035		4.567		4.394	0,01
5,885 % fällig am 25.10.2035		6.885		5.620	0,01
5,915 % fällig am 25.02.2035		3.660		3.344	0,01
6,080 % fällig am 25.11.2034		2.945		2.817	0,01
6,095 % fällig am 25.06.2035		479		475	0,00
6,095 % fällig am 25.09.2035		7.903		7.638	0,01
6,125 % fällig am 25.11.2034		277		271	0,00
6,125 % fällig am 25.06.2035		4.903		4.696	0,01
6,155 % fällig am 25.07.2035		12.000		11.629	0,02
6,215 % fällig am 25.03.2035		342		307	0,00
Newcastle Mortgage Securities Trust					
5,340 % fällig am 25.04.2037		2.549		2.414	0,00
5,380 % fällig am 25.04.2037		9.678		9.407	0,02
5,825 % fällig am 25.03.2036		6.394		6.259	0,01
Nomura Home Equity Loan, Inc. Home Equity Loan Trust					
5,430 % fällig am 25.07.2036		10.729		8.755	0,01
5,630 % fällig am 25.03.2036		2.393		2.230	0,00
5,645 % fällig am 25.03.2036		5.146		4.757	0,01
5,810 % fällig am 25.11.2035		3.981		3.767	0,01
5,810 % fällig am 25.10.2036 ^		7.122		1.610	0,00
5,915 % fällig am 25.05.2035		1.664		1.621	0,00
5,950 % fällig am 25.02.2037 ^		9.883		2.944	0,01
6,492 % fällig am 25.02.2037 ^		5.287		1.503	0,00
6,532 % fällig am 25.10.2036 ^		2.657		638	0,00
NovaStar Mortgage Funding Trust					
5,300 % fällig am 25.03.2037		3.093		1.100	0,00
5,330 % fällig am 25.03.2037		26.588		9.452	0,02
5,330 % fällig am 25.09.2037		3.655		3.338	0,01
5,350 % fällig am 25.09.2037		9.942		9.634	0,02
5,450 % fällig am 25.06.2036		2.845		2.002	0,00
5,450 % fällig am 25.09.2036		5.204		2.257	0,00
5,470 % fällig am 25.05.2036		3.056		2.989	0,01
5,490 % fällig am 25.11.2036		1.281		401	0,00
5,490 % fällig am 25.01.2037		19.066		6.681	0,01
5,690 % fällig am 25.05.2036		400		374	0,00
5,840 % fällig am 25.01.2036		5.700		5.241	0,01
5,855 % fällig am 25.01.2036		943		932	0,00
5,870 % fällig am 25.10.2035		2.653		2.603	0,00
5,885 % fällig am 25.01.2036		5.000		4.661	0,01
5,975 % fällig am 25.06.2034		1.591		1.534	0,00
6,875 % fällig am 25.12.2034		770		674	0,00
7,025 % fällig am 25.03.2035		2.983		2.929	0,01
Oakwood Mortgage Investors, Inc.					
5,050 % fällig am 15.11.2019		133		126	0,00
Option One Mortgage Loan Trust					
5,250 % fällig am 25.07.2036		2.065		928	0,00
5,270 % fällig am 25.03.2037		6.015		5.676	0,01
5,280 % fällig am 25.07.2037		11.283		7.251	0,01
5,290 % fällig am 25.01.2037		17.049		11.040	0,02
5,290 % fällig am 25.02.2037		19.767		12.993	0,02
5,290 % fällig am 25.03.2037		13.988		8.020	0,01
5,320 % fällig am 25.05.2037		20.038		10.985	0,02
5,330 % fällig am 25.04.2037		669		336	0,00
5,330 % fällig am 25.07.2037		4.694		3.017	0,01
5,340 % fällig am 25.07.2037		1.789		1.516	0,00
5,350 % fällig am 25.07.2036		10.014		5.787	0,01
5,370 % fällig am 25.01.2037		7.384		4.239	0,01
5,370 % fällig am 25.04.2037		34.212		24.357	0,04
5,370 % fällig am 25.05.2037		5.056		2.982	0,01
5,400 % fällig am 25.03.2037		2.549		1.259	0,00

BESCHREIBUNG		PAR (000S)		MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
5,690 % fällig am 25.01.2036	$	17.298	$	15.434	0,02
5,885 % fällig am 25.05.2035		3.000		2.794	0,00
5,885 % fällig am 25.08.2035		158		154	0,00
5,945 % fällig am 25.05.2034		1.941		1.868	0,00
6,020 % fällig am 25.05.2035		700		570	0,00
Option One Mortgage Loan Trust Asset-Backed Certificates					
5,840 % fällig am 25.11.2035		2.469		2.317	0,00
Ownit Mortgage Loan Trust					
3,157 % fällig am 25.12.2035 ^		1.051		612	0,00
5,370 % fällig am 25.07.2037		1.164		971	0,00
OZLM Ltd.					
6,300 % fällig am 20.04.2031		1.000		990	0,00
OZLME DAC					
4,162 % fällig am 24.08.2030	€	2.308		2.469	0,00
Palmer Square CLO Ltd.					
6,390 % fällig am 17.01.2031	$	807		802	0,00
Palmer Square European CLO DAC					
1,970 % fällig am 15.04.2035	€	6.000		5.348	0,01
Palmer Square European Loan Funding DAC					
4,727 % fällig am 15.11.2032		35.600		38.436	0,06
Park Place Securities, Inc.					
5,885 % fällig am 25.09.2035	$	6.045		5.902	0,01
6,095 % fällig am 25.09.2035		2.506		2.261	0,00
Park Place Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates					
5,885 % fällig am 25.08.2035		6.752		6.479	0,01
5,885 % fällig am 25.09.2035		6.612		6.361	0,01
5,945 % fällig am 25.07.2035		3.191		3.151	0,01
6,095 % fällig am 25.06.2035		624		618	0,00
6,125 % fällig am 25.07.2035		5.600		4.575	0,01
6,155 % fällig am 25.06.2035		2.903		2.748	0,00
6,185 % fällig am 25.05.2035		3.000		2.363	0,00
6,200 % fällig am 25.09.2034		3.506		3.452	0,01
6,200 % fällig am 25.06.2035		1.992		1.640	0,00
6,275 % fällig am 25.03.2035		828		799	0,00
6,470 % fällig am 25.01.2036 ^		5.451		4.961	0,01
6,725 % fällig am 25.02.2035		8.091		7.825	0,01
6,920 % fällig am 25.10.2034		5.729		5.409	0,01
6,950 % fällig am 25.12.2034		8.743		8.602	0,01
7,025 % fällig am 25.12.2034		6.871		6.140	0,01
7,250 % fällig am 25.09.2034		107		92	0,00
Penta CLO DAC					
4,211 % fällig am 25.01.2033	€	10.000		10.679	0,02
People's Choice Home Loan Securities Trust					
5,830 % fällig am 25.12.2035 ^	$	6.467		6.162	0,01
6,005 % fällig am 25.08.2035		5.159		4.843	0,01
6,095 % fällig am 25.05.2035 ^		678		609	0,00
6,125 % fällig am 25.05.2035		7.624		4.426	0,01
People's Financial Realty Mortgage Securities Trust					
5,390 % fällig am 25.09.2036		10.753		2.118	0,00
Popular ABS Mortgage Pass-Through Trust					
3,467 % fällig am 25.11.2035		314		308	0,00
5,410 % fällig am 25.11.2036		589		583	0,00
5,460 % fällig am 25.06.2047 ^		888		821	0,00
5,645 % fällig am 25.07.2036		2.258		2.113	0,00
5,735 % fällig am 25.02.2036		1.441		1.415	0,00
5,917 % fällig am 25.04.2035		1.431		1.354	0,00
Pretium Mortgage Credit Partners LLC					
2,240 % fällig am 27.09.2060		10.766		10.177	0,02
Project Silver					
3,967 % fällig am 15.07.2044		17.539		15.068	0,02
RAAC Trust					
5,420 % fällig am 25.05.2036		144		140	0,00
5,650 % fällig am 25.02.2037		2.492		2.385	0,00
5,750 % fällig am 25.06.2044		1.232		1.022	0,00
5,800 % fällig am 25.06.2047		1.967		1.901	0,00
5,840 % fällig am 25.11.2036		300		299	0,00
5,910 % fällig am 25.10.2046		2.035		1.928	0,00
6,005 % fällig am 25.03.2037		886		879	0,00
6,350 % fällig am 25.10.2045		141		137	0,00
Raptor Aircraft Finance LLC					
4,213 % fällig am 23.08.2044		47.428		37.353	0,06
Renaissance Home Equity Loan Trust					
5,285 % fällig am 25.01.2037		2.814		979	0,00
5,294 % fällig am 25.01.2037		18.457		6.432	0,01
5,512 % fällig am 25.04.2037		8.724		2.394	0,00
5,545 % fällig am 25.01.2037		2.357		861	0,00
5,608 % fällig am 25.05.2036		6.713		3.252	0,01

BESCHREIBUNG		PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
5,612 % fällig am 25.04.2037	$	5.992	$ 1.706	0,00
5,675 % fällig am 25.06.2037 ^		421	122	0,00
5,731 % fällig am 25.11.2036		4.836	1.822	0,00
5,742 % fällig am 25.04.2037		16.856	4.816	0,01
5,744 % fällig am 25.06.2037 ^		5.934	1.740	0,00
5,746 % fällig am 25.05.2036		2.134	1.059	0,00
5,761 % fällig am 25.04.2037		2.781	797	0,00
5,762 % fällig am 25.08.2036		8.258	3.290	0,01
5,797 % fällig am 25.08.2036		12.841	5.228	0,01
5,812 % fällig am 25.11.2036		8.748	3.340	0,01
5,857 % fällig am 25.05.2035		2.071	1.729	0,00
5,879 % fällig am 25.06.2037 ^		2.974	893	0,00
5,890 % fällig am 25.08.2035		2.790	2.449	0,00
5,893 % fällig am 25.06.2037 ^		28.633	8.624	0,01
5,906 % fällig am 25.06.2037		7.657	2.311	0,00
5,910 % fällig am 25.12.2032		41	37	0,00
6,011 % fällig am 25.05.2036		3.091	1.601	0,00
6,120 % fällig am 25.11.2036		11.903	4.777	0,01
6,166 % fällig am 25.05.2036		3.374	1.791	0,00
6,511 % fällig am 25.07.2034		1.197	1.029	0,00
6,998 % fällig am 25.09.2037 ^		9.381	4.089	0,01
7,238 % fällig am 25.09.2037 ^		9.551	4.161	0,01
Residential Asset Mortgage Products Trust				
5,500 % fällig am 25.10.2036		4.320	4.043	0,01
5,610 % fällig am 25.12.2035		540	433	0,00
5,660 % fällig am 25.03.2036		1.155	1.113	0,00
5,690 % fällig am 25.02.2036		3.799	3.580	0,01
5,710 % fällig am 25.07.2036		936	928	0,00
5,795 % fällig am 25.02.2036		500	467	0,00
5,830 % fällig am 25.12.2035		5.119	4.440	0,01
5,930 % fällig am 25.07.2035		126	125	0,00
5,930 % fällig am 25.09.2035		1.533	1.392	0,00
6,095 % fällig am 25.10.2035		2.856	2.327	0,00
6,125 % fällig am 25.07.2035		1.906	1.781	0,00
6,170 % fällig am 25.05.2035		880	867	0,00
6,200 % fällig am 25.08.2035		2.035	1.984	0,00
6,215 % fällig am 25.05.2035		2.457	2.300	0,00
6,275 % fällig am 25.06.2035		2.600	2.465	0,00
6,350 % fällig am 25.01.2035 ^		2.470	2.257	0,00
Residential Asset Securities Corp. Trust				
4,754 % fällig am 25.04.2034		480	461	0,00
4,906 % fällig am 25.06.2034		1.846	1.787	0,00
5,358 % fällig am 25.01.2037		6.581	5.512	0,01
5,370 % fällig am 25.01.2037		3.804	3.510	0,01
5,370 % fällig am 25.02.2037		6.826	6.511	0,01
5,410 % fällig am 25.07.2036		27	27	0,00
5,430 % fällig am 25.07.2036		3.837	3.612	0,01
5,430 % fällig am 25.09.2036		3.589	3.490	0,01
5,490 % fällig am 25.04.2037		6.836	6.354	0,01
5,570 % fällig am 25.06.2036		40	39	0,00
5,585 % fällig am 25.06.2036		3.422	3.263	0,01
5,660 % fällig am 25.04.2036		5.275	4.609	0,01
5,690 % fällig am 25.07.2036		2.403	2.066	0,00
5,710 % fällig am 25.04.2036		1.251	1.220	0,00
5,735 % fällig am 25.03.2036		2.561	2.523	0,00
5,750 % fällig am 25.02.2036		1.410	1.382	0,00
5,765 % fällig am 25.11.2035		98	93	0,00
5,780 % fällig am 25.02.2036		2.810	2.625	0,00
5,795 % fällig am 25.03.2035		153	152	0,00
5,810 % fällig am 25.11.2035		761	756	0,00
5,810 % fällig am 25.12.2035		3.988	3.784	0,01
5,830 % fällig am 25.05.2037		1.182	1.153	0,00
5,840 % fällig am 25.11.2035		997	979	0,00
5,855 % fällig am 25.09.2035		895	837	0,00
5,855 % fällig am 25.10.2035		2.047	1.687	0,00
5,855 % fällig am 25.11.2035		476	455	0,00
5,870 % fällig am 25.01.2036		4.882	4.707	0,01
6,020 % fällig am 25.11.2035		3.825	3.091	0,01
6,110 % fällig am 25.08.2035		3.088	3.029	0,01
6,185 % fällig am 25.10.2035		2.013	1.893	0,00
6,395 % fällig am 25.03.2035		1.010	956	0,00
6,950 % fällig am 25.04.2035		653	623	0,00
Residential Funding Mortgage Securities Home Equity Loan Trust				
5,400 % fällig am 25.12.2035 ^		1.548	238	0,00
RRE Loan Management DAC				
4,217 % fällig am 15.10.2036	€	3.500	3.728	0,01
Sapphire Aviation Finance Ltd.				
4,250 % fällig am 15.03.2040	$	29.081	24.233	0,04
Saranac CLO Ltd.				
7,120 % fällig am 22.06.2030		24.994	24.762	0,04

BESCHREIBUNG		PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
Saxon Asset Securities Trust				
1,501 % fällig am 25.11.2035	$	2.994	$ 2.867	0,01
1,942 % fällig am 25.05.2035		3.960	3.471	0,01
3,831 % fällig am 25.08.2035		3.464	3.354	0,01
5,330 % fällig am 25.05.2037		2.532	1.786	0,00
5,350 % fällig am 25.05.2047		8.831	7.654	0,01
5,460 % fällig am 25.09.2037		9.438	8.911	0,01
5,550 % fällig am 25.09.2047		3.640	3.331	0,01
5,600 % fällig am 25.09.2036 ^		7.983	6.226	0,01
5,630 % fällig am 25.10.2046		1.480	1.233	0,00
5,640 % fällig am 25.09.2047		5.418	4.300	0,01
5,810 % fällig am 25.10.2035		3.657	3.454	0,01
5,870 % fällig am 25.11.2037		2.500	2.025	0,00
6,125 % fällig am 26.12.2034		629	528	0,00
6,900 % fällig am 25.12.2037		7.596	6.397	0,01
SBA Tower Trust				
3,869 % fällig am 15.10.2049		5.000	4.848	0,01
Securitized Asset-Backed Receivables LLC Trust				
5,270 % fällig am 25.12.2036 ^		150	36	0,00
5,280 % fällig am 25.05.2037 ^		8	6	0,00
5,310 % fällig am 25.08.2036		2.774	895	0,00
5,350 % fällig am 25.05.2037 ^		4.892	2.945	0,01
5,410 % fällig am 25.12.2036		3.303	2.969	0,01
5,430 % fällig am 25.05.2036		7.522	4.048	0,01
5,430 % fällig am 25.06.2036		635	402	0,00
5,430 % fällig am 25.09.2036		4.112	3.768	0,01
5,430 % fällig am 25.01.2037		6.163	5.236	0,01
5,450 % fällig am 25.03.2036		2.631	1.650	0,00
5,450 % fällig am 25.09.2036		5.828	2.115	0,00
5,450 % fällig am 25.12.2036		551	302	0,00
5,470 % fällig am 25.09.2036		1.659	1.129	0,00
5,470 % fällig am 25.10.2036		1.079	376	0,00
5,490 % fällig am 25.08.2036 ^		12.271	3.957	0,01
5,590 % fällig am 25.01.2037		1.035	729	0,00
5,630 % fällig am 25.07.2036		7.523	2.641	0,00
5,690 % fällig am 25.03.2036		482	423	0,00
5,750 % fällig am 25.11.2035		3.672	2.985	0,01
5,795 % fällig am 25.10.2035		2.286	1.895	0,00
5,825 % fällig am 25.01.2035		547	510	0,00
5,870 % fällig am 25.10.2035		1.750	1.402	0,00
6,035 % fällig am 25.10.2035		2.927	2.369	0,00
6,110 % fällig am 25.01.2036 ^		637	556	0,00
Segovia European CLO DAC				
4,080 % fällig am 20.07.2032	€	4.600	4.890	0,01
SG Mortgage Securities Trust				
5,470 % fällig am 25.07.2036	$	23.205	4.988	0,01
5,510 % fällig am 25.02.2036		3.621	2.076	0,00
5,690 % fällig am 25.02.2036		1.905	1.102	0,00
5,855 % fällig am 25.10.2035		921	842	0,00
6,035 % fällig am 25.10.2035		1.083	864	0,00
SLM Private Credit Student Loan Trust				
5,882 % fällig am 15.06.2039		13.999	13.454	0,02
SLM Student Loan Trust				
3,661 % fällig am 25.10.2039	€	2.260	2.300	0,00
3,811 % fällig am 25.07.2039		12.693	13.085	0,02
3,811 % fällig am 25.01.2040		24.600	24.561	0,04
4,076 % fällig am 15.12.2033		9.706	9.772	0,02
6,955 % fällig am 25.07.2023	$	7.253	7.249	0,01
SMB Private Education Loan Trust				
5,993 % fällig am 15.02.2036		1.333	1.320	0,00
SoFi Alternative Trust				
3,491 % fällig am 15.06.2050		16.081	15.343	0,02
3,688 % fällig am 16.05.2050		16.811	16.167	0,03
Soloso CDO Ltd.				
5,471 % fällig am 07.10.2037		3.722	3.462	0,01
Soundview Home Loan Trust				
5,230 % fällig am 25.06.2037		3.262	2.197	0,00
5,270 % fällig am 25.11.2036		8.708	2.529	0,00
5,300 % fällig am 25.03.2037		5.321	4.952	0,01
5,300 % fällig am 25.06.2037		17.304	11.652	0,02
5,310 % fällig am 25.01.2037		8.937	6.467	0,01
5,320 % fällig am 25.07.2037		781	642	0,00
5,320 % fällig am 25.08.2037		8.033	6.804	0,01
5,330 % fällig am 25.07.2037		6.520	5.555	0,01
5,350 % fällig am 25.02.2037		33.336	10.547	0,02
5,350 % fällig am 25.06.2037		22.425	15.325	0,02
5,450 % fällig am 25.07.2036		83	82	0,00
5,450 % fällig am 25.01.2037		3.400	3.140	0,01
5,490 % fällig am 25.11.2036		5.406	1.570	0,00
5,555 % fällig am 25.12.2036		6.170	5.995	0,01
5,570 % fällig am 25.06.2036 ^		5.647	4.787	0,01

BESCHREIBUNG		PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
5,600 % fällig am 25.05.2036	$	10.343	$ 8.122	0,01
5,615 % fällig am 25.02.2036		3.890	3.536	0,01
5,615 % fällig am 25.06.2036 ^		7.736	6.357	0,01
5,630 % fällig am 25.07.2036		22.931	19.583	0,03
5,650 % fällig am 25.10.2036		12.593	11.759	0,02
5,650 % fällig am 25.11.2036		2.978	2.765	0,00
5,668 % fällig am 25.03.2036		6.864	5.594	0,01
5,675 % fällig am 25.03.2036		504	499	0,00
5,710 % fällig am 25.10.2036		3.665	3.547	0,01
5,840 % fällig am 25.12.2035		8.776	7.814	0,01
5,900 % fällig am 25.01.2035		480	431	0,00
5,990 % fällig am 25.08.2035 ^		4.602	4.011	0,01
6,050 % fällig am 25.10.2037		16.813	13.269	0,02
6,080 % fällig am 25.11.2035		57	57	0,00
6,100 % fällig am 25.09.2037		1.733	1.356	0,00
6,125 % fällig am 25.03.2036		3.410	2.974	0,01
6,150 % fällig am 25.09.2037		4.192	2.849	0,01
6,185 % fällig am 25.05.2035		652	640	0,00
6,230 % fällig am 25.07.2035		532	526	0,00
6,250 % fällig am 25.09.2037		1.565	1.225	0,00
Southern Pacific Secured Asset Corp.				
5,550 % fällig am 25.03.2028		64	59	0,00
Specialty Underwriting & Residential Finance Trust				
3,597 % fällig am 25.09.2037		3.242	1.092	0,00
3,863 % fällig am 25.09.2037		7.355	6.480	0,01
5,270 % fällig am 25.04.2037		789	540	0,00
5,350 % fällig am 25.04.2037		2.969	2.050	0,00
5,450 % fällig am 25.06.2037		1.828	1.056	0,00
5,450 % fällig am 25.11.2037		8.930	4.976	0,01
5,500 % fällig am 25.03.2037		1.563	879	0,00
5,500 % fällig am 25.04.2037		424	296	0,00
6,125 % fällig am 25.12.2035		1.351	1.324	0,00
St. Paul's CLO DAC				
4,097 % fällig am 15.04.2033	€	1.200	1.280	0,00
START Ltd.				
4,089 % fällig am 15.03.2044	$	12.408	10.943	0,02
Starwood Commercial Mortgage Trust				
6,296 % fällig am 15.07.2038		17.408	17.261	0,03
6,616 % fällig am 15.07.2038		14.830	14.089	0,02
6,816 % fällig am 15.07.2038		5.930	5.650	0,01
Structured Asset Investment Loan Trust				
5,280 % fällig am 25.07.2036		718	516	0,00
5,300 % fällig am 25.07.2036		2.557	2.470	0,00
5,323 % fällig am 25.07.2036		15.556	9.276	0,02
5,470 % fällig am 25.05.2036		221	213	0,00
5,530 % fällig am 25.03.2036		1.628	1.576	0,00
5,700 % fällig am 25.09.2034		3.970	3.700	0,01
5,750 % fällig am 25.04.2036		8.832	4.753	0,01
5,770 % fällig am 25.01.2036		3.791	3.491	0,01
5,780 % fällig am 25.11.2035		6.873	6.582	0,01
5,855 % fällig am 25.03.2034		166	160	0,00
5,870 % fällig am 25.04.2033		566	554	0,00
5,870 % fällig am 25.04.2035		2.703	2.639	0,00
5,870 % fällig am 25.07.2035		283	265	0,00
5,870 % fällig am 25.09.2035		1.520	1.488	0,00
5,870 % fällig am 25.10.2035		118	114	0,00
5,870 % fällig am 25.01.2036		4.125	3.938	0,01
5,900 % fällig am 25.07.2035		1.568	1.504	0,00
5,915 % fällig am 25.08.2035		1.939	1.838	0,00
6,050 % fällig am 25.05.2035		4.128	4.016	0,01
6,080 % fällig am 25.01.2035		4.584	4.431	0,01
6,080 % fällig am 25.06.2035		5.691	5.354	0,01
6,150 % fällig am 25.09.2034		3.363	3.286	0,01
6,275 % fällig am 25.07.2033		370	364	0,00
6,350 % fällig am 25.12.2034		388	383	0,00
6,378 % fällig am 25.09.2034		354	340	0,00
6,425 % fällig am 25.12.2034		1.302	1.249	0,00
6,530 % fällig am 25.04.2033		13	12	0,00
6,650 % fällig am 25.11.2034		699	697	0,00
Structured Asset Securities Corp.				
4,273 % fällig am 25.02.2035		1.691	1.660	0,00
6,290 % fällig am 25.02.2035		584	560	0,00
Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust				
4,600 % fällig am 25.08.2034		59	56	0,00
5,280 % fällig am 25.05.2036		3.169	3.046	0,01
5,300 % fällig am 25.04.2036		3.434	3.344	0,01
5,305 % fällig am 25.09.2036		9.557	6.009	0,01
5,310 % fällig am 25.01.2037		8.333	7.799	0,01
5,320 % fällig am 25.01.2037		971	952	0,00
5,330 % fällig am 25.03.2036		1.201	1.185	0,00
5,370 % fällig am 25.10.2037		19.201	12.348	0,02
5,380 % fällig am 25.01.2037		14.977	9.065	0,01

BESCHREIBUNG		PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
5,380 % fällig am 25.02.2037	$	12.258	$ 11.699	0,02
5,380 % fällig am 25.05.2047		6.733	6.387	0,01
5,390 % fällig am 25.01.2037		2.000	1.862	0,00
5,440 % fällig am 25.07.2036 ^		6.958	6.619	0,01
5,460 % fällig am 25.08.2046		4.471	4.150	0,01
5,490 % fällig am 25.12.2036		603	591	0,00
5,570 % fällig am 25.02.2037		185	179	0,00
5,580 % fällig am 25.03.2037		3.949	2.941	0,01
5,650 % fällig am 25.11.2037		21.706	16.526	0,03
5,675 % fällig am 25.07.2036		1.547	1.430	0,00
5,770 % fällig am 25.12.2036		13.350	7.681	0,01
5,770 % fällig am 25.02.2037		5.002	4.724	0,01
5,825 % fällig am 25.04.2035		113	101	0,00
5,825 % fällig am 25.06.2035		114	106	0,00
6,050 % fällig am 25.08.2037		2.465	2.421	0,00
6,080 % fällig am 25.05.2035		409	410	0,00
6,155 % fällig am 25.11.2035		1.000	983	0,00
7,175 % fällig am 25.07.2035		1.430	1.432	0,00
7,250 % fällig am 25.11.2035		129	123	0,00
Structured Asset Securities Corp. Mortgage Pass-Through Certificates				
5,975 % fällig am 25.01.2035		517	505	0,00
Structured Asset Securities Corp. Trust				
5,420 % fällig am 25.05.2031		344	244	0,00
6,888 % fällig am 25.05.2031		1.283	1.023	0,00
Symphony CLO Ltd.				
6,140 % fällig am 15.04.2028		3.822	3.808	0,01
Taberna Preferred Funding Ltd.				
5,666 % fällig am 05.05.2038		7.958	7.481	0,01
5,686 % fällig am 05.12.2036		23.607	20.361	0,03
5,693 % fällig am 05.07.2035		8.668	7.714	0,01
5,756 % fällig am 05.11.2035		15.300	13.961	0,02
Terwin Mortgage Trust				
3,971 % fällig am 25.08.2036		1.084	189	0,00
5,490 % fällig am 25.07.2037		5.092	4.834	0,01
5,950 % fällig am 25.09.2036		3.194	1.377	0,00
TICP CLO Ltd.				
6,390 % fällig am 20.01.2031		13.483	13.396	0,02
Toro European CLO DAC				
3,917 % fällig am 15.10.2030	€	1.379	1.476	0,00
4,097 % fällig am 15.07.2030		2.451	2.655	0,00
Trapeza CDO Ltd.				
5,509 % fällig am 06.04.2042	$	6.135	5.399	0,01
5,551 % fällig am 10.10.2041		3.775	3.247	0,01
5,559 % fällig am 06.07.2041		8.759	7.368	0,01
5,604 % fällig am 09.11.2042		635	573	0,00
5,619 % fällig am 06.07.2041		9.000	6.570	0,01
Tropic CDO Ltd.				
5,580 % fällig am 15.07.2036		12.747	11.727	0,02
6,010 % fällig am 15.04.2034		117	116	0,00
Truman Capital Mortgage Loan Trust				
5,630 % fällig am 25.03.2036		1.294	1.136	0,00
TruPS Financials Note Securitization Ltd.				
6,708 % fällig am 30.03.2039		28.348	27.072	0,04
7,080 % fällig am 20.09.2039		7.127	6.663	0,01
Venture CLO Ltd.				
6,140 % fällig am 15.04.2027		19.161	19.099	0,03
Vesey Park CLO DAC				
4,298 % fällig am 16.11.2032	€	4.500	4.804	0,01
Voya Euro CLO DAC				
3,927 % fällig am 15.10.2030		9.583	10.324	0,02
WaMu Asset-Backed Certificates WaMu Trust				
5,280 % fällig am 25.07.2047	$	5.797	3.349	0,01
5,300 % fällig am 25.01.2037		18.591	15.239	0,02
5,320 % fällig am 25.05.2037		3.389	2.790	0,00
5,320 % fällig am 25.07.2047		578	400	0,00
5,340 % fällig am 25.04.2037		24.897	9.435	0,02
5,375 % fällig am 25.05.2037		809	741	0,00
5,400 % fällig am 25.05.2037		3.247	2.689	0,00
5,400 % fällig am 25.07.2047		5.563	3.220	0,01
5,510 % fällig am 25.04.2037		788	300	0,00
Washington Mutual Asset-Backed Certificates Trust				
5,450 % fällig am 25.05.2036		826	624	0,00
Wells Fargo Home Equity Asset-Backed Securities Trust				
5,470 % fällig am 25.07.2036		3.200	3.038	0,01
5,495 % fällig am 25.01.2037		3.813	3.653	0,01
5,570 % fällig am 25.03.2037		1.563	1.525	0,00
5,610 % fällig am 25.04.2037		2.280	2.212	0,00
5,660 % fällig am 25.05.2036		3.877	3.757	0,01
5,750 % fällig am 25.04.2037	$	1.000	$ 689	0,00
6,150 % fällig am 25.10.2034		745	731	0,00
6,875 % fällig am 25.11.2035		3.475	3.422	0,01
7,250 % fällig am 25.11.2035		2.472	2.365	0,00
7,550 % fällig am 25.12.2034		817	800	0,00
7,700 % fällig am 25.04.2035		751	752	0,00
8,900 % fällig am 25.04.2035		1.592	1.652	0,00
Wells Fargo Home Equity Trust Mortgage Pass-Through Certificates				
5,890 % fällig am 25.04.2034		207	199	0,00
			4.948.687	7,67

STAATSEMISSIONEN

BESCHREIBUNG		PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
Argentina Government International Bond				
0,500 % fällig am 09.07.2030		337.885	103.087	0,16
1,000 % fällig am 09.07.2029		18.219	5.957	0,01
1,500 % fällig am 09.07.2035		278.448	81.689	0,13
1,500 % fällig am 09.07.2046		8.050	2.429	0,00
3,500 % fällig am 09.07.2041		170.054	54.761	0,09
3,875 % fällig am 09.01.2038		115.791	40.919	0,06
15,500 % fällig am 17.10.2026	ARS	297.359	120	0,00
Argentina Treasury Bond BONCER				
1,450 % fällig am 13.08.2023		4.839.759	9.687	0,02
Australia Government International Bond				
1,750 % fällig am 21.06.2051	AUD	204.800	79.401	0,12
Autonome Stadt Buenos Aires				
95,317 % fällig am 29.03.2024 (a)	ARS	1.161.075	2.319	0,00
95,645 % fällig am 22.02.2028 (a)		766.034	1.490	0,00
Export-Credit Bank of Turkey				
8,250 % fällig am 24.01.2024	$	13.400	13.391	0,02
Israel Government International Bond				
3,800 % fällig am 13.05.2060		161.411	122.968	0,19
4,500 % fällig am 03.04.2120		4.400	3.567	0,01
Peru Government International Bond				
5,350 % fällig am 12.08.2040	PEN	2.300	532	0,00
5,400 % fällig am 12.08.2034		121	30	0,00
5,940 % fällig am 12.02.2029		13.761	3.731	0,01
6,150 % fällig am 12.08.2032		12.060	3.189	0,01
6,900 % fällig am 12.08.2037		7.647	2.094	0,00
6,950 % fällig am 12.08.2031		30.370	8.532	0,01
Provincia de Buenos Aires				
88,734 % fällig am 12.04.2025 (a)	ARS	3.331.617	6.033	0,01
Republic of Greece Government International Bond				
3,750 % fällig am 30.01.2028 (n)	€	4.618	5.095	0,01
3,900 % fällig am 30.01.2033		9.948	11.155	0,02
4,000 % fällig am 30.01.2037		6.211	6.868	0,01
4,200 % fällig am 30.01.2042		3.488	3.927	0,01
Romania Government International Bond				
1,750 % fällig am 13.07.2030	€	2.600	$ 2.169	0,00
2,000 % fällig am 14.04.2033		16.400	12.672	0,02
2,125 % fällig am 07.03.2028		3.100	2.942	0,00
2,750 % fällig am 14.04.2041		30.800	20.676	0,03
3,750 % fällig am 07.02.2034		14.300	12.642	0,02
Russia Government International Bond				
1,850 % fällig am 20.11.2032 ^		2.800	1.436	0,00
4,250 % fällig am 23.06.2027 ^	$	116.200	50.699	0,08
4,375 % fällig am 21.03.2029 ^		6.000	2.670	0,00
4,750 % fällig am 27.05.2026 ^		115.600	58.378	0,09
5,100 % fällig am 28.03.2035 ^		20.000	8.900	0,01
5,250 % fällig am 23.06.2047 ^		33.600	14.952	0,02
5,250 % fällig am 23.06.2047 ^		311.800	18.708	0,03
5,625 % fällig am 04.04.2042 ^		98.400	67.095	0,10
5,875 % fällig am 16.09.2043 ^		26.600	16.776	0,03
7,150 % fällig am 12.11.2025 ^	RUB	20.520.713	120.029	0,19
7,500 % fällig am 31.03.2030 ^	$	16.872	11.131	0,02
7,950 % fällig am 07.10.2026 ^	RUB	7.973.492	46.638	0,07
12,750 % fällig am 24.06.2028 ^	$	41.736	41.371	0,06
South Africa Government International Bond				
10,500 % fällig am 21.12.2026	ZAR	11.472.400	630.697	0,98
State Agency of Roads of Ukraine				
6,250 % fällig am 24.06.2030 ^	$	1.500	329	0,00
Turkey Government International Bond				
4,250 % fällig am 13.03.2025		201.100	188.079	0,29
5,250 % fällig am 13.03.2030 (n)		155.000	127.560	0,20
6,125 % fällig am 24.10.2028		28.900	25.892	0,04
7,625 % fällig am 26.04.2029		94.000	88.957	0,14
Ukraine Government International Bond				
4,375 % fällig am 27.01.2032 ^	€	18.760	4.473	0,01
Venezuela Government International Bond				
6,000 % fällig am 09.12.2020 ^	$	9.289	581	0,00
7,000 % fällig am 31.03.2038 ^		14.228	1.245	0,00
7,650 % fällig am 21.04.2025 ^		28.167	2.465	0,00
7,750 % fällig am 13.10.2019 ^		5.850	351	0,00
8,250 % fällig am 13.10.2024 ^		35.331	3.268	0,01
9,000 % fällig am 07.05.2023 ^		13.516	1.216	0,00
9,250 % fällig am 15.09.2027 ^		34.519	3.107	0,00
9,250 % fällig am 07.05.2028 ^		39.817	3.583	0,01
11,750 % fällig am 21.10.2026 ^		3.990	369	0,00
12,750 % fällig am 23.08.2022 ^		6.170	555	0,00
			2.165.582	3,35

BESCHREIBUNG	AKTIEN	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
STAMMAKTIEN			
KOMMUNIKATIONSDIENSTE			
Clear Channel Outdoor Holdings, Inc. (e)	26.868.244	$ 36.809	0,06
iHeartMedia, Inc. 'A' (e)	6.332.872	23.052	0,04
iHeartMedia, Inc. 'B' (e)	4.913.662	16.097	0,02
Intelsat Emergence S.A. (e)(m)	4.649.159	106.931	0,16
		182.889	0,28
BASISKONSUMGÜTER			
Neiman Marcus Group Ltd. LLC (e)(m)	1.179.713	179.237	0,28
ENERGIE			
Constellation Oil Services Holding S.A. 'B' (e)(m)	3.258.324	353	0,00
FINANZWERTE			
Cairo Mezz PLC (e)	3.408.327	446	0,00
Eurobank Ergasias Services and Holdings S.A. 'A' (e)	32.351.328	53.292	0,08
Stearns Holdings LLC 'B' (e)	1.114.539	0	0,00
UBS Group AG	126.509	2.565	0,01
Voyager Aviation Holdings LLC (e)	2.155	0	0,00
		56.303	0,09
INDUSTRIEWERTE			
Sierra Hamilton Holder LLC (e)(m)	2.210.032	0	0,00
Westmoreland Mining Holdings LLC (e)(m)	82.938	374	0,00
		374	0,00
IMMOBILIEN			
Adler Group S.A. (e)	10.156	5	0,00
Adler Group S.A.	22.487	14	0,00
		19	0,00
		419.175	0,65
RECHTE			
Intelsat Jackson Holdings S.A. - Exp. 05.12.2025	1.026.237	6.078	0,01
OPTIONSSCHEINE			
Constellation Oil Services Holding S.A. 'D' - Exp. 10.06.2071 (m)	4	0	0,00
Guaranteed Rate, Inc. - Exp. 31.12.2060	5.339	0	0,00
Intelsat Emergence S.A. - Exp. 17.02.2027	160.093	250	0,00
Windstream Holdings II, LLC - Exp. 21.09.2055	2.022.886	30.970	0,05
		31.220	0,05
VORZUGSWERTPAPIERE			
Nationwide Building Society 10,250 %	859.974	125.965	0,20
Voyager Aviation Holdings LLC 9,500 %	12.927	3.117	0,00
		129.082	0,20

BESCHREIBUNG	AKTIEN	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
REAL ESTATE INVESTMENT TRUSTS			
CBL & Associates Properties, Inc.	95.496	2.105	0,00
Uniti Group, Inc.	726.414	3.356	0,01
VICI Properties, Inc.	5.793.243	182.081	0,28
		187.542	0,29
KURZFRISTIGE INSTRUMENTE			
COMMERCIAL PAPER			
American Electric Power Co., Inc.			
5,440 % fällig am 07.08.2023 $	14.200	$ 14.118	0,02
5,440 % fällig am 08.08.2023	11.900	11.829	0,02
Arrow Electronics, Inc.			
5,730 % fällig am 18.07.2023	10.800	10.769	0,02
Bacardi-Martini BV			
5,750 % fällig am 12.07.2023	1.100	1.098	0,00
Conagra Foods, Inc.			
5,600 % fällig am 20.07.2023	30.000	29.904	0,05
Constellation Brands, Inc.			
5,580 % fällig am 21.07.2023	1.500	1.495	0,00
5,580 % fällig am 25.07.2023	4.800	4.781	0,01
Constellation Energy Corp.			
5,300 % fällig am 13.07.2023	11.700	11.675	0,02
CVS Health Corp.			
5,280 % fällig am 06.07.2023	18.400	18.384	0,03
Dominion Resources, Inc.			
5,430 % fällig am 31.07.2023	27.600	27.472	0,04
5,500 % fällig am 15.08.2023	1.950	1.936	0,00
5,520 % fällig am 18.08.2023	21.950	21.786	0,03
Duke Energy Corp.			
5,400 % fällig am 08.08.2023	22.600	22.466	0,04
Enbridge, Inc.			
5,450 % fällig am 25.07.2023	13.300	13.249	0,02
5,450 % fällig am 26.07.2023	15.500	15.438	0,02
Enel Finance America LLC			
5,450 % fällig am 26.07.2023	11.500	11.456	0,02
Global Payments, Inc.			
5,930 % fällig am 26.07.2023	22.100	22.006	0,03
5,930 % fällig am 28.07.2023	65.800	65.500	0,10
Humana, Inc.			
5,430 % fällig am 20.07.2023	4.500	4.486	0,01
5,500 % fällig am 01.08.2023	9.800	9.751	0,02
5,510 % fällig am 02.08.2023	11.800	11.740	0,02
5,510 % fällig am 03.08.2023	8.200	8.157	0,01
Internal FLV+FGR, Inc.			
6,000 % fällig am 28.07.2023	12.600	12.547	0,02
Keurig Dr Pepper, Inc.			
5,250 % fällig am 05.07.2023	47.800	47.766	0,07
5,350 % fällig am 20.07.2023	26.400	26.322	0,04
McCormick & Co., Inc.			
5,350 % fällig am 25.07.2023	9.800	9.763	0,02
Mondelez International, Inc.			
5,370 % fällig am 24.07.2023	22.300	22.221	0,03
5,370 % fällig am 25.07.2023	22.300	22.218	0,03
Penske Truck Leasing Co. LP			
5,350 % fällig am 14.07.2023	3.900	3.892	0,01
Quanta Services, Inc.			
5,900 % fällig am 17.07.2023	9.150	9.126	0,01
5,900 % fällig am 18.07.2023	20.850	20.791	0,03
Targa Resources Corp.			
5,950 % fällig am 26.07.2023	13.800	13.749	0,02
VW Credit, Inc.			
5,400 % fällig am 26.07.2023	25.200	25.102	0,04
5,430 % fällig am 27.07.2023	55.900	55.673	0,09
5,440 % fällig am 02.08.2023	3.000	2.985	0,00
Walgreens Boots Alliance			
5,850 % fällig am 10.07.2023 (c)	35.800	35.743	0,06
Waste Management, Inc.			
5,400 % fällig am 09.08.2023	10.600	10.536	0,02
		657.930	1,02

BESCHREIBUNG		AKTIEN	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
KURZFRISTIGE SCHULDTITEL				
Corestate Capital Holding S.A. 15,000 % fällig am 31.07.2023 (m)	€	1.000	1.102	0,00
ARGENTINA TREASURY BILLS				
(54,758) % fällig am 18.09.2023 (f)(g)	ARS	11.858.799	23.564	0,03
(28,578) % fällig am 18.10.2023 (f)(g)		15.279.143	30.196	0,05
(12,549) % fällig am 23.11.2023 (f)(g)		6.230.659	12.569	0,02
2,749 % fällig am 18.09.2023 (f)(g)		6.904.764	13.720	0,02
			80.049	0,12
JAPAN TREASURY BILLS				
(0,211) % fällig am 24.07.2023 (f)(g)	¥	11.876.000	$ 82.173	0,13
(0,206) % fällig am 18.07.2023 (f)(g)		10.461.000	72.381	0,11
(0,202) % fällig am 28.08.2023 (f)(g)		50.000.000	346.005	0,54
(0,200) % fällig am 28.08.2023 (f)(g)		2.655.000	18.373	0,03
(0,199) % fällig am 11.09.2023 (f)(g)		48.697.000	337.004	0,52
(0,197) % fällig am 31.07.2023 (f)(g)		4.484.000	31.027	0,05
(0,190) % fällig am 04.09.2023 (f)(g)		15.632.000	108.177	0,17
(0,189) % fällig am 28.08.2023 (f)(g)		19.398.000	134.236	0,21
(0,188) % fällig am 18.07.2023 (f)(g)		4.926.000	34.083	0,05
(0,188) % fällig am 28.08.2023 (f)(g)		74.527.000	515.734	0,80
(0,182) % fällig am 24.07.2023 (f)(g)		6.304.000	43.619	0,07
(0,179) % fällig am 11.09.2023 (f)(g)		28.020.000	193.910	0,30
(0,178) % fällig am 31.07.2023 (f)(g)		2.421.000	16.752	0,03
(0,173) % fällig am 19.09.2023 (f)(g)		12.646.000	87.518	0,13
(0,172) % fällig am 19.09.2023 (f)(g)		10.232.000	70.812	0,11
(0,170) % fällig am 04.09.2023 (f)(g)		12.340.000	85.396	0,13
(0,169) % fällig am 19.09.2023 (f)(g)		268.000	1.855	0,00
(0,153) % fällig am 19.09.2023 (f)(g)		16.506.000	114.232	0,18
(0,152) % fällig am 25.09.2023 (f)(g)		15.798.000	109.334	0,17
(0,132) % fällig am 25.09.2023 (f)(g)		21.579.000	149.344	0,23
			2.551.965	3,96
Summe kurzfristige Instrumente			3.291.046	5,10
Summe Übertragbare Wertpapiere			$ 79.018.485	122,45

	AKTIEN		
INVESTMENTFONDS			
ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN			
PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (j)	220.495.538	2.195.687	3,40
BÖRSENGEHANDELTE FONDS			
PIMCO ETFs plc - PIMCO US Dollar Short Maturity UCITS ETF (j)	2.903.000	288.355	0,45
Summe Investmentfonds		$ 2.484.042	3,85

PENSIONSGESCHÄFTE

Kontrahent	Kredit-zins	Abrechnungs-datum	Fälligkeits-datum	Kapital-betrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensions-geschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensions-geschäft[1]	% des Nettovermögens
BPS	4,660 %	30.06.2023	05.07.2023	CAD 500.000	Canada Government International Bond 2,500 % fällig am 01.12.2032	$ (225.563)	$ 377.858	$ 378.177	0,59
					Province of Quebec 1,900 % - 2,750 % fällig am 01.09.2027 - 01.09.2030	(161.448)			
	5,080	30.06.2023	07.07.2023	$ 500.000	U.S. Treasury Notes 0,250 % - 1,875 % fällig am 31.07.2025 - 31.07.2026	(510.165)	500.000	500.494	0,78
BRC	5,120	30.06.2023	03.07.2023	417.900	U.S. Treasury Notes 3,875 % fällig am 30.04.2025	(426.648)	417.900	418.078	0,65
FICC	2,400	30.06.2023	03.07.2023	122.098	U.S. Treasury Notes 4,625 % fällig am 30.06.2025	(124.540)	122.098	122.122	0,19
MBC	5,130	28.06.2023	05.07.2023	200.000	U.S. Treasury Bills 0,000 % fällig am 01.08.2023	(144.409)	200.000	200.200	0,31
					U.S. Treasury Bonds 4,000 % fällig am 15.11.2042	(49.959)			
					U.S. Treasury Notes 2,625 % fällig am 31.12.2023	(10.645)			
	5,150	30.06.2023	07.07.2023	150.000	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.07.2024 - 15.07.2030	(60.417)	150.000	150.150	0,23
					U.S. Treasury Notes 0,250 % - 2,250 % fällig am 15.11.2024 - 30.09.2025	(94.406)			
	5,160	30.06.2023	03.07.2023	208.100	U.S. Treasury Notes 3,875 % - 4,125 % fällig am 30.11.2027 - 15.11.2032	(214.861)	208.100	208.189	0,32
NXN	5,140	30.06.2023	03.07.2023	105.100	U.S. Treasury Bonds 2,875 % fällig am 15.05.2049	(108.590)	105.100	105.145	0,16
SOG	5,130	31.05.2023	TBD[2]	9.545	American International Group, Inc. 4,800 % fällig am 10.07.2045	(3.115)	9.545	9.545	0,01
					Amgen, Inc. 3,625 % fällig am 22.05.2024	(1.966)			
					Barclays PLC 4,337 % fällig am 10.01.2028	(3.300)			
					Morgan Stanley 1,593 % fällig am 04.05.2027	(1.791)			
Summe Pensionsgeschäfte						**$ (2.141.823)**	**$ 2.090.601**	**$ 2.092.100**	**3,24**

[1] Umfasst aufgelaufene Zinsen.
[2] Pensionsgeschäft mit offener Laufzeit

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

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

FUTURES

Beschreibung	Art	Ablauf-monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
3-Month SOFR December Futures	Short	03.2024	2.299	$ 15.355	0,02
3-Month SOFR December Futures	Short	03.2025	1.188	5.242	0,01
3-Month SOFR December Futures	Short	03.2026	1.289	4.198	0,01
3-Month SOFR June Futures	Short	09.2024	1.498	8.763	0,01
3-Month SOFR June Futures	Short	09.2025	1.206	4.402	0,01
3-Month SOFR March Futures	Short	06.2024	1.990	12.742	0,02
3-Month SOFR March Futures	Short	06.2025	1.087	4.306	0,01
3-Month SOFR March Futures	Short	06.2026	1.206	3.704	0,01
3-Month SOFR September Futures	Short	12.2024	1.390	7.087	0,01
3-Month SOFR September Futures	Short	12.2025	986	3.368	0,01
Australia Government 10-Year Bond September Futures	Short	09.2023	230	89	0,00
Euro-Bund 10-Year Bond September Futures	Short	09.2023	3.629	4.846	0,01
U.S. Treasury 2-Year Note September Futures	Long	09.2023	793	(2.238)	(0,01)
U.S. Treasury 5-Year Note September Futures	Long	09.2023	3.439	(7.380)	(0,01)
U.S. Treasury 10-Year Note September Futures	Long	09.2023	17.853	(15.340)	(0,03)
U.S. Treasury 10-Year Ultra September Futures	Long	09.2023	881	(1.080)	0,00
U.S. Treasury 30-Year Bond September Futures	Short	09.2023	6.124	(589)	0,00
U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond September Futures	Short	09.2023	6.106	(11.324)	(0,02)
				$ 36.151	0,06

VERKAUFSOPTIONEN

OPTIONEN AUF BÖRSENGEHANDELTE TERMINKONTRAKTE

Beschreibung	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Anzahl der Kontrakte	Aufgeld	Markt-wert	% des Nettovermögens
Put - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note August Futures	$ 111,500	21.07.2023	1.147	$ (500)	$ (431)	0,00
Call - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note August Futures	115,500	21.07.2023	1.147	(402)	(57)	0,00
Put - CBOT U.S. Treasury 30-Year Bond August Futures	123,000	21.07.2023	335	(129)	(51)	0,00
Call - CBOT U.S. Treasury 30-Year Bond August Futures	131,000	21.07.2023	335	(172)	(66)	0,00
Call - CME-Kaufoptionen mit Ausübungskurs bei 96,000 USD auf 3-Month SOFR September Futures	96,000	15.09.2023	1.518	(2.502)	(110)	0,00
Call - CME-Kaufoptionen mit Ausübungskurs bei 96,063 USD auf 3-Month SOFR December Futures	96,063	15.12.2023	1.602	(3.282)	(336)	0,00
Call - CME-Kaufoptionen mit Ausübungskurs bei 96,125 USD auf 3-Month SOFR December Futures	96,125	15.12.2023	1.518	(2.806)	(309)	0,00
Call - CME-Kaufoptionen mit Ausübungskurs bei 96,188 USD auf 3-Month SOFR September Futures	96,188	15.09.2023	2.276	(4.434)	(134)	0,00
Call - CME-Kaufoptionen mit Ausübungskurs bei 96,375 USD auf 3-Month SOFR December Futures	96,375	15.12.2023	2.276	(4.742)	(374)	0,00
Call - CME-Kaufoptionen mit Ausübungskurs bei 98,000 USD auf 3-Month SOFR December Futures	98,000	15.12.2023	1.218	(359)	(63)	0,00
Put - CME-Verkaufsoptionen mit Ausübungskurs bei 96,000 USD auf 3-Month SOFR September Futures	96,000	15.09.2023	1.518	(2.882)	(5.356)	(0,01)
Put - CME-Verkaufsoptionen mit Ausübungskurs bei 96,063 USD auf 3-Month SOFR December Futures	96,063	15.12.2023	1.602	(3.122)	(5.896)	(0,01)
Put - CME-Verkaufsoptionen mit Ausübungskurs bei 96,125 USD auf 3-Month SOFR December Futures	96,125	15.12.2023	1.518	(2.920)	(5.815)	(0,01)
Put - CME-Verkaufsoptionen mit Ausübungskurs bei 96,188 USD auf 3-Month SOFR September Futures	96,188	15.09.2023	2.276	(4.499)	(9.053)	(0,01)
Put - CME-Verkaufsoptionen mit Ausübungskurs bei 96,375 USD auf 3-Month SOFR December Futures	96,375	15.12.2023	2.276	(4.833)	(10.038)	(0,02)
Put - CME-Verkaufsoptionen mit Ausübungskurs bei 96,500 USD auf 3-Month SOFR December Futures	96,500	15.12.2023	1.218	(479)	(5.737)	(0,01)
				$ (38.063)	$ (43.826)	(0,07)
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate					**$ (7.675)**	**(0,01)**

ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)

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

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMMISSIONEN - SCHUTZVERKAUF[1]

Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag[3]	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Airbus Finance BV	1,000 %	20.06.2028	€ 13.400	$ (94)	0,00
AT&T, Inc.	1,000	20.12.2023	$ 11.100	(109)	0,00
AT&T, Inc.	1,000	20.06.2024	69.900	313	0,00
AT&T, Inc.	1,000	20.12.2025	9.500	(58)	0,00
AT&T, Inc.	1,000	20.06.2026	9.400	(84)	0,00
AT&T, Inc.	1,000	20.06.2028	4.300	31	0,00
Barclays Bank PLC	1,000	20.12.2023	€ 25.600	(1)	0,00
Boeing Co.	1,000	20.12.2023	$ 20.400	95	0,00
Boeing Co.	1,000	20.12.2024	5.570	174	0,00
Boeing Co.	1,000	20.06.2025	11.800	263	0,00
Boeing Co.	1,000	20.12.2025	11.700	292	0,00
Ford Motor Co.	5,000	20.12.2024	12.100	(496)	0,00
Ford Motor Co.	5,000	20.06.2026	3.300	(78)	0,00
Ford Motor Co.	5,000	20.12.2026	4.400	(148)	0,00
Ford Motor Co.	5,000	20.06.2027	3.300	(14)	0,00
Ford Motor Credit Co. LLC	5,000	20.06.2024	18.900	(8)	0,00
Ford Motor Credit Co. LLC	5,000	20.12.2024	44.900	(258)	0,00
Ford Motor Credit Co. LLC	5,000	20.06.2025	24.800	(225)	0,00
Ford Motor Credit Co. LLC	5,000	20.12.2025	25.300	953	0,00
Ford Motor Credit Co. LLC	5,000	20.06.2026	8.200	(159)	0,00
Ford Motor Credit Co. LLC	5,000	20.12.2026	6.600	(123)	0,00
Ford Motor Credit Co. LLC	5,000	20.06.2027	11.500	(102)	0,00
General Electric Co.	1,000	20.12.2023	109.900	6.087	0,01
General Electric Co.	1,000	20.12.2024	7.600	198	0,00
General Electric Co.	1,000	20.06.2026	53.500	148	0,00
General Electric Co.	1,000	20.12.2026	6.700	(7)	0,00
Rolls-Royce PLC	1,000	20.06.2025	€ 10.000	641	0,00
Rolls-Royce PLC	1,000	20.12.2025	25.100	2.210	0,00
Rolls-Royce PLC	1,000	20.06.2026	41.400	2.428	0,01
Rolls-Royce PLC	1,000	20.12.2026	114.700	2.386	0,01
Rolls-Royce PLC	1,000	20.06.2027	18.100	923	0,00
Verizon Communications, Inc.	1,000	20.06.2026	$ 6.700	(102)	0,00
Verizon Communications, Inc.	1,000	20.12.2026	32.300	(539)	0,00
Verizon Communications, Inc.	1,000	20.06.2028	34.900	122	0,00
				$ 14.659	0,03

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES - SCHUTZKAUF[2]

Index/Tranchen	Zu bezahlender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag[3]	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
CDX.IG-35 5-Year Index	(1,000) %	20.12.2025	$ 107.200	$ 1.063	0,00

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES - SCHUTZVERKAUF[1]

Index/Tranchen	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag[3]	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
CDX.EM-30 5-Year Index	1,000 %	20.12.2023	$ 378.250	$ 6.617	0,01
CDX.EM-31 5-Year Index	1,000	20.06.2024	99.588	4.024	0,01
CDX.EM-32 5-Year Index	1,000	20.12.2024	71.910	3.328	0,01
CDX.EM-34 5-Year Index	1,000	20.12.2025	218.224	4.447	0,01
CDX.EM-35 5-Year Index	1,000	20.06.2026	1.380	20	0,00
CDX.EM-36 5-Year Index	1,000	20.12.2026	705.640	37.066	0,05
CDX.EM-37 5-Year Index	1,000	20.06.2027	6.958	322	0,00
CDX.EM-38 5-Year Index	1,000	20.12.2027	98.900	4.258	0,01
CDX.EM-39 5-Year Index	1,000	20.06.2028	194.100	5.117	0,01
CDX.HY-34 5-Year Index	5,000	20.06.2025	5.040	(255)	0,00
CDX.HY-35 5-Year Index	5,000	20.12.2025	8.330	(350)	0,00
CDX.HY-36 5-Year Index	5,000	20.06.2026	417.578	6.815	0,01
CDX.HY-37 5-Year Index	5,000	20.12.2026	149.646	(651)	0,00
CDX.HY-38 5-Year Index	5,000	20.06.2027	27.146	1.263	0,00
CDX.HY-39 5-Year Index	5,000	20.12.2027	675.675	12.116	0,01
CDX.HY-40 5-Year Index	5,000	20.06.2028	4.399.800	122.269	0,19
CDX.IG-37 5-Year Index	1,000	20.12.2026	1.400	(10)	0,00
CDX.IG-38 5-Year Index	1,000	20.06.2027	400	3	0,00
CDX.IG-39 5-Year Index	1,000	20.12.2027	12.700	37	0,00
CDX.IG-40 5-Year Index	1,000	20.06.2028	99.700	719	0,00
				$ 207.155	0,32

ZINSSWAPS

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Erhalt	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	0,500 %	16.09.2030	£ 254.700	$ 23.157	0,04
Zahlung	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	1,060	21.02.2052	14.400	(8.598)	(0,01)
Zahlung	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	1,096	14.02.2052	31.300	(18.473)	(0,03)
Zahlung	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	1,101	21.02.2052	14.400	(8.469)	(0,01)
Zahlung	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	1,175	28.02.2052	28.800	(16.436)	(0,03)
Erhalt[4]	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	3,500	20.09.2033	903.200	65.793	0,10
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,000	20.09.2026	¥ 48.830.000	(4.125)	(0,01)
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,000	15.03.2029	344.670.000	(6.871)	(0,01)
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,020	20.09.2028	395.820.000	32.006	0,05
Zahlung	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,176	27.04.2027	22.270.000	146	0,00
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,400	15.06.2032	52.440.000	(349)	0,00
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,500	15.03.2042	27.980.000	(393)	0,00
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,711	27.04.2042	5.840.000	43	0,00
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	0,000	04.07.2023	$ 212.800	2.894	0,00
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	0,000	18.07.2023	157.300	2.127	0,00
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	0,000	26.07.2023	154.700	2.098	0,00
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	0,000	04.08.2023	7.957.500	109.789	0,17
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	0,000	09.08.2023	22.000	(304)	0,00
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	0,000	06.09.2023	344.400	4.796	0,01
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	0,000	15.09.2023	324.000	(4.522)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	0,000	16.09.2023	1.456.600	(20.781)	(0,03)
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	0,000	16.09.2023	33.800	482	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	0,000	30.09.2023	1.155.100	(16.017)	(0,02)
Zahlung[4]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	0,500	16.06.2026	1.090.500	(79.704)	(0,12)
Zahlung[4]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	0,500	16.06.2028	2.503.737	(241.629)	(0,37)
Erhalt[4]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	0,550	15.01.2031	4.567.800	982.369	1,52
Erhalt[4]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	0,674	05.08.2030	62.900	12.876	0,02
Erhalt[4]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	0,678	29.07.2030	65.200	13.342	0,02
Erhalt[4]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	0,711	28.07.2030	69.000	14.019	0,02
Erhalt[4]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	0,715	27.07.2030	200.000	40.617	0,06
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	0,750	30.03.2031	963.600	196.348	0,30
Zahlung[4]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	0,750	16.06.2031	3.358.883	(367.694)	(0,57)
Erhalt[4]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	0,800	15.01.2051	1.479.300	713.175	1,10
Erhalt[4]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	0,928	06.05.2026	150.100	14.456	0,02
Erhalt[4]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	0,975	17.06.2052	52.200	17.761	0,03
Erhalt[4]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	0,990	24.06.2052	75.000	25.185	0,04
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,000	26.01.2024	154.700	(4.747)	(0,01)
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,000	15.06.2027	386.590	30.986	0,05
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,000	15.06.2029	495.770	49.020	0,08
Erhalt[4]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,000	16.12.2030	120.615	21.044	0,03
Erhalt[4]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,035	28.06.2052	25.900	8.466	0,01
Zahlung[4]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,144	04.11.2050	49.600	(19.562)	(0,03)
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,150	30.03.2051	191.500	2.818	0,00
Zahlung[4]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,215	13.10.2050	83.500	(32.963)	(0,05)

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Erhalt[4]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,235 %	12.05.2028	$ 75.400	$ 9.529	0,01
Zahlung[4]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,250	15.12.2026	1.654.500	(176.098)	(0,27)
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,250	15.06.2032	15.560	2.146	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,250	15.06.2032	635.270	(58.442)	(0,09)
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,250	16.06.2051	1.456.600	314.245	0,49
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,270	04.11.2023	7.957.500	(130.424)	(0,20)
Zahlung[4]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,280	24.03.2028	423.400	(48.033)	(0,07)
Erhalt[4]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,306	02.11.2051	48.000	15.261	0,02
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,317	16.12.2050	33.800	(12.597)	(0,02)
Erhalt[4]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,350	20.01.2027	109.100	10.887	0,02
Erhalt[4]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,360	15.02.2027	387.430	37.853	0,06
Erhalt[4]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,360	20.07.2031	91.400	15.994	0,02
Erhalt[4]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,370	19.07.2031	61.300	10.688	0,02
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,380	04.01.2027	212.800	(22.159)	(0,03)
Erhalt[4]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,405	07.09.2031	154.300	26.370	0,04
Zahlung[4]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,418	20.01.2027	71.900	(6.903)	(0,01)
Erhalt[4]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,420	24.02.2027	269.100	25.624	0,04
Zahlung[4]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,425	18.01.2027	146.000	(13.861)	(0,02)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,443	18.01.2027	157.300	(15.843)	(0,02)
Erhalt[4]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,450	17.02.2027	361.600	34.255	0,05
Erhalt[4]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,450	16.07.2031	137.000	23.438	0,04
Zahlung[4]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,485	13.01.2051	78.100	(27.380)	(0,04)
Zahlung[4]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,500	15.12.2028	473.684	(65.682)	(0,10)
Erhalt[4]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,500	12.01.2029	85.443	10.864	0,02
Zahlung[4]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,500	05.10.2031	89.100	(14.695)	(0,02)
Zahlung[4]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,518	20.01.2029	43.100	(5.328)	(0,01)
Zahlung[4]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,535	15.10.2031	88.600	(14.370)	(0,02)
Zahlung[4]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,535	22.10.2031	59.100	(9.528)	(0,02)
Zahlung[4]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,545	26.10.2031	58.900	(9.457)	(0,01)
Zahlung[4]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,550	20.01.2027	485.100	(43.633)	(0,07)
Zahlung[4]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,570	11.01.2027	121.400	(11.060)	(0,02)
Zahlung[4]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,570	12.01.2027	76.200	(6.944)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,573	28.02.2027	96.300	(9.321)	(0,01)
Zahlung[4]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,580	16.02.2027	150.400	(13.220)	(0,02)
Zahlung[4]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,595	13.01.2051	82.600	(27.264)	(0,04)
Erhalt[4]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,600	16.01.2026	943.900	34.589	0,05
Zahlung[4]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,600	15.02.2027	1.549.700	(134.234)	(0,21)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,618	09.02.2029	27.100	(3.271)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,620	18.04.2027	153.700	(14.029)	(0,02)
Zahlung[4]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,630	20.01.2029	60.000	(7.090)	(0,01)
Zahlung[4]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,630	26.01.2029	72.000	(8.448)	(0,01)
Zahlung[4]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,650	24.02.2027	897.000	(75.618)	(0,12)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,650	08.02.2032	91.900	(13.952)	(0,02)
Zahlung[4]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,655	24.01.2032	72.000	(11.214)	(0,02)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,700	06.03.2024	344.400	(8.167)	(0,01)
Zahlung[4]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,700	17.02.2027	1.446.200	(120.063)	(0,19)
Zahlung[4]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,700	12.01.2029	310.700	(35.290)	(0,05)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,730	24.02.2032	86.300	(12.502)	(0,02)
Zahlung[4]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,735	12.01.2032	57.800	(8.723)	(0,01)
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,750	15.06.2029	190.144	9.856	0,02
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,750	15.06.2032	209.290	10.754	0,02
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,750	15.06.2032	96.400	(7.381)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,765	16.03.2032	30.400	(4.262)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,770	14.02.2032	81.500	(11.616)	(0,02)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,783	22.04.2027	114.300	(9.672)	(0,02)
Erhalt[4]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,785	12.08.2051	76.100	24.140	0,04
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,788	03.05.2027	114.800	(9.643)	(0,02)
Zahlung[4]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,815	24.01.2052	14.400	(4.220)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,817	05.04.2032	318.600	(42.961)	(0,07)
Zahlung[4]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,867	26.01.2052	14.400	(4.071)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,872	06.04.2032	160.000	(20.862)	(0,03)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,928	25.03.2027	159.500	(13.114)	(0,02)
Erhalt[4]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,945	23.06.2051	127.800	35.483	0,05
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,988	09.02.2032	22.000	2.908	0,00
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,000	21.12.2027	193.480	4.494	0,01
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,000	21.12.2029	910.590	20.739	0,03
Zahlung[4]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,000	18.02.2032	133.700	(16.784)	(0,03)
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,000	21.12.2032	1.477.810	34.423	0,05
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,000	15.12.2051	324.000	7.909	0,01
Erhalt[4]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,008	09.02.2032	36.700	4.703	0,01
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,185	21.04.2029	96.000	(8.304)	(0,01)
Erhalt[4]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,300	17.01.2026	678.900	24.629	0,04
Erhalt[4]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,350	17.01.2025	1.204.900	28.135	0,04
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,370	21.06.2027	159.400	(9.426)	(0,01)
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,385	08.06.2032	26.800	2.201	0,00
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,430	30.09.2027	230.020	17.758	0,03
Erhalt[4]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,450	20.12.2024	2.408.100	57.132	0,09
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,450	04.10.2027	221.690	16.907	0,03
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,451	08.06.2032	90.600	7.087	0,01
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,605	28.06.2027	158.600	(7.813)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,680	11.07.2032	27.300	(1.847)	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,690	11.07.2032	27.300	(1.818)	0,00

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits-datum		Nenn-betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,850 %	30.08.2027	$	137.400	$ (7.192)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,880	30.09.2027		657.200	(32.153)	(0,05)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,900	04.10.2027		633.400	(30.567)	(0,05)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,955	04.10.2027		141.800	(6.523)	(0,01)
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,000	21.06.2030		2.179.420	63.299	0,10
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,000	21.06.2033		710.885	22.496	0,03
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,050	07.09.2027		69.900	(3.016)	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,050	08.09.2029		69.900	(3.016)	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,050	06.09.2032		104.600	(4.504)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,080	23.02.2053		29.400	(538)	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,100	09.09.2029		70.000	(2.804)	0,00
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,250	21.06.2028		2.045.860	60.887	0,09
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,300	06.03.2033		54.100	(1.279)	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,340	23.02.2030		86.000	(2.133)	0,00
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,350	14.12.2032		28.200	847	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,370	01.03.2033		52.300	(886)	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,400	23.02.2033		49.800	(735)	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,405	01.03.2033		53.700	(758)	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,420	24.05.2033		88.200	(824)	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,425	01.03.2033		53.900	(695)	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,430	27.02.2033		53.600	(664)	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,450	07.03.2033		109.100	(1.184)	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,470	22.02.2030		102.500	(1.720)	0,00
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,500	21.06.2026		195.110	4.168	0,01
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,500	22.06.2030		175.800	(1.569)	0,00
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,500	22.05.2033		5.163.180	(14.692)	(0,02)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,500	21.06.2033		117.200	(81)	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,525	02.03.2030		37.900	(523)	0,00
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,610	12.12.2032		56.700	478	0,00
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,700	06.06.2033		3.050.720	(7.502)	(0,01)
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,750	13.12.2027		141.600	2.564	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,800	10.03.2028		104.800	(867)	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	4,040	20.06.2024		364.200	(2.763)	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	4,060	20.06.2024		1.457.000	(10.772)	(0,02)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	4,140	22.06.2024		607.100	(4.008)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	4,500	22.05.2025		11.396.340	(48.351)	(0,08)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	4,900	06.06.2025		6.663.690	(3.156)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	5,100	22.05.2024		22.102.670	(24.246)	(0,04)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	5,400	06.06.2024		12.921.420	11.269	0,02
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,140	02.01.2025	BRL	26.500	(93)	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,160	02.01.2025		17.600	(60)	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,220	04.01.2027		32.000	66	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,245	04.01.2027		16.100	36	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,260	04.01.2027		16.200	37	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,350	02.01.2025		21.800	(56)	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,700	04.01.2027		8.300	42	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,715	04.01.2027		35.900	187	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,870	04.01.2027		85.800	529	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	12,000	02.01.2025		59.500	21	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	12,080	02.01.2025		98.900	71	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	12,140	02.01.2025		49.800	49	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	12,145	02.01.2025		48.800	49	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	12,160	02.01.2025		99.600	107	0,00
Erhalt	3-Month CAD-Bank Bill	1,000	16.06.2047	CAD	2.600	693	0,00
Erhalt	3-Month CAD-Bank Bill	1,300	16.06.2047		2.500	638	0,00
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	3,400	20.06.2029		6.300	(712)	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	0,000	04.07.2023	$	212.800	(2.853)	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	0,000	18.07.2023		157.300	(2.110)	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	0,000	26.07.2023		154.700	(2.075)	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	0,000	04.08.2023		7.957.500	(109.160)	(0,17)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	0,000	09.08.2023		22.000	301	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	0,000	06.09.2023		344.400	(4.843)	(0,01)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	0,000	15.09.2023		324.000	4.596	0,01
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	0,000	16.09.2023		1.456.600	20.933	0,03
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	0,000	16.09.2023		33.800	(486)	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	0,000	30.09.2023		1.155.100	16.136	0,02
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	0,500	16.09.2023		3.594.237	(46.794)	(0,07)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	0,550	15.07.2023		4.567.800	48.659	0,08
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	0,674	05.08.2023		62.900	666	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	0,678	29.07.2023		65.200	681	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	0,711	28.07.2023		69.000	683	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	0,715	27.07.2023		200.000	1.978	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	0,750	16.09.2023		3.358.883	(41.837)	(0,06)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	0,800	15.07.2023		1.479.300	13.903	0,02
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	0,928	06.08.2023		150.100	1.667	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	0,975	17.09.2023		52.200	594	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	0,990	24.09.2023		75.000	866	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,000	16.09.2023		120.615	1.425	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,035	28.09.2023		25.900	298	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,144	04.08.2023		49.600	(538)	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,215	13.07.2023		83.500	(861)	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,235	12.08.2023		75.400	817	0,00

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits-datum		Nenn-betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,250 %	15.09.2023	$	1.654.500	$ (18.300)	(0,03)
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,280	24.09.2023		423.400	(3.210)	(0,01)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,306	02.08.2023		48.000	496	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,350	20.07.2023		109.100	721	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,360	20.07.2023		91.400	600	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,360	15.08.2023		387.430	2.659	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,370	19.07.2023		61.300	401	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,405	07.09.2023		154.300	1.095	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,418	20.07.2023		71.900	(451)	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,420	24.08.2023		269.100	1.801	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,425	18.07.2023		146.000	(915)	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,450	16.07.2023		137.000	841	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,450	17.08.2023		361.600	2.327	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,485	13.07.2023		78.100	(462)	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,500	05.07.2023		89.100	(851)	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,500	12.07.2023		85.443	490	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,500	15.09.2023		473.684	(4.943)	(0,01)
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,518	20.07.2023		43.100	(249)	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,535	15.07.2023		88.600	(845)	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,535	22.07.2023		59.100	(565)	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,545	26.07.2023		58.900	(561)	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,550	20.07.2023		485.100	(2.721)	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,570	11.07.2023		121.400	(657)	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,570	12.07.2023		76.200	(410)	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,580	16.08.2023		150.400	(866)	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,595	13.07.2023		82.600	(443)	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,600	15.08.2023		1.549.700	(8.778)	(0,01)
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,630	20.07.2023		60.000	(313)	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,630	26.07.2023		72.000	(378)	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,650	24.08.2023		897.000	(4.975)	(0,01)
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,655	24.07.2023		72.000	(370)	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,700	12.07.2023		310.700	(1.469)	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,700	17.08.2023		1.446.200	(7.503)	(0,01)
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,735	12.07.2023		57.800	(263)	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,785	12.08.2023		76.100	384	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,815	24.07.2023		14.400	(62)	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,867	26.07.2023		14.400	(58)	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,945	23.09.2023		127.800	1.211	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	2,000	18.08.2023		133.700	(521)	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,008	09.08.2023		36.700	134	0,00
Zahlung	6-Month AUD-BBR-BBSW	2,750	17.06.2026	AUD	72.880	(2.076)	0,00
Zahlung	6-Month AUD-BBR-BBSW	3,000	21.03.2027		1.179.040	(54.438)	(0,08)
Zahlung	6-Month AUD-BBR-BBSW	3,250	17.12.2024		197.200	(8.816)	(0,01)
Zahlung	6-Month AUD-BBR-BBSW	3,500	17.06.2025		361.600	(21.281)	(0,03)
Zahlung	6-Month AUD-BBR-BBSW	4,250	17.12.2024		97.200	(8.686)	(0,01)
Zahlung	6-Month AUD-BBR-BBSW	4,750	18.06.2024		124.400	(13.332)	(0,02)
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	0,150	18.03.2030	€	907.700	18.200	0,03
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	0,150	17.06.2030		244.000	2.942	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	0,294	30.06.2026		6.200	743	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	0,329	30.12.2025		13.200	1.407	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	0,363	30.06.2025		20.500	1.805	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	0,395	30.12.2024		10.800	771	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	0,425	28.06.2024		24.600	1.171	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	0,453	29.12.2023		25.200	662	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	0,500	17.06.2050		126.900	59.328	0,09
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	0,650	12.04.2027		331.900	(35.249)	(0,05)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	0,700	11.04.2027		113.000	(11.846)	(0,02)
Erhalt[4]	6-Month EUR-EURIBOR	0,830	09.12.2052		1.064.900	51.697	0,08
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	1,000	13.05.2027		243.100	(22.803)	(0,04)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	1,000	18.05.2027		116.300	(10.904)	(0,02)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	1,750	21.09.2027		355.500	(21.251)	(0,03)
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	2,000	17.09.2024		149.000	20.973	0,03
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,000	21.09.2032		170.580	(18.124)	(0,03)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,100	11.04.2024		197.900	(3.100)	(0,01)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,100	13.04.2024		407.800	(6.402)	(0,01)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,100	17.05.2024		183.200	(3.101)	(0,01)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,250	26.04.2024		200.100	(2.777)	0,00
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,250	28.04.2024		184.600	(2.748)	0,00
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,250	03.05.2024		184.500	(2.757)	0,00
Zahlung[4]	6-Month EUR-EURIBOR	2,500	20.09.2053		300	7	0,00
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,547	09.03.2033		127.800	(2.839)	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	7,165	06.09.2032	MXN	266.600	(917)	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	7,360	21.08.2037		285.500	(639)	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	7,380	14.08.2037		111.200	6	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	7,480	18.06.2037		337.300	(1.175)	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	7,495	14.01.2032		2.373.500	(5.253)	(0,01)
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	7,498	15.01.2032		5.192.600	(11.416)	(0,02)
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	7,498	19.06.2037		810.000	(2.774)	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	8,103	04.01.2038		3.750.800	(1.347)	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	8,280	28.11.2036		690.000	(3.180)	(0,01)
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	8,310	28.11.2036		1.066.400	(5.047)	(0,01)
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	8,410	31.03.2027		1.182.800	514	0,00

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits-datum		Nenn-betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	8,660 %	04.04.2024	MXN	2.723.700	$ 3.031	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	8,675	03.04.2024		9.876.200	10.940	0,02
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	8,701	31.03.2032		905.900	(1.914)	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	8,730	06.04.2027		787.600	(55)	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	8,732	30.03.2032		394.000	(875)	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	8,750	05.04.2024		1.956.500	2.097	0,00
Zahlung	UKRPI	4,000	15.09.2031	£	53.800	(10.126)	(0,02)
Zahlung	UKRPI	4,020	15.10.2031		69.900	(12.663)	(0,02)
Zahlung	UKRPI	4,055	15.09.2031		49.800	(9.273)	(0,01)
Zahlung	UKRPI	4,066	15.09.2031		96.800	(16.301)	(0,03)
Zahlung	UKRPI	4,140	15.10.2031		135.400	(22.552)	(0,04)
Zahlung	UKRPI	4,250	15.11.2031		135.600	(19.058)	(0,03)
Zahlung	UKRPI	4,400	15.10.2031		60.700	(8.777)	(0,01)
						$ 639.520	0,99
Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate						**$ 862.397**	**1,34**

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

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

(3) Der maximal mögliche Betrag, den der Fonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

(4) Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft.

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

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

OPTIONSKAUF

ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag[1]	Kosten	Markt-wert	% des Nettovermö-gens
FAR	Call - OTC 2-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,243 %	05.08.2024	291.100	$ 3.930	$ 818	0,00
	Put - OTC 2-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,243	05.08.2024	291.100	3.930	8.769	0,02
GLM	Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,110	26.07.2032	59.200	9.590	6.963	0,01
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,110	26.07.2032	85.900	13.916	17.142	0,03
MYC	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,053	20.07.2023	869.400	5.216	0	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,053	20.07.2023	869.400	5.216	19.130	0,03
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,620	22.07.2024	869.400	6.520	1.478	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,620	22.07.2024	869.400	6.521	13.486	0,02
	Call - OTC 2-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,590	19.07.2024	616.200	8.473	2.299	0,00
	Put - OTC 2-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,590	19.07.2024	616.200	8.473	15.638	0,03
	Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,400	20.07.2027	68.100	8.986	5.676	0,01
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,400	20.07.2027	76.800	10.134	12.620	0,02
	Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,170	19.07.2032	68.100	10.801	8.179	0,01
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,170	19.07.2032	76.800	12.180	14.861	0,02
							$ 113.886	$ 127.059	0,20

VERKAUFSOPTIONEN

ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag[1]	Aufgeld	Markt-wert	% des Nettovermö-gens
BOA	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,150 %	01.12.2023	158.300	$ (491)	$ (17)	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,650	01.12.2023	158.300	(491)	(2.141)	(0,01)
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,380	31.07.2023	61.300	(236)	(292)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,780	31.07.2023	61.300	(236)	(180)	0,00
	Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,070	10.07.2023	40.100	(263)	(100)	0,00
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,370	10.07.2023	40.100	(263)	(31)	0,00
	Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,060	14.07.2023	22.800	(166)	(102)	0,00
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,360	14.07.2023	22.800	(166)	(54)	0,00
BPS	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,200	06.07.2023	30.200	(97)	0	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,650	06.07.2023	30.200	(97)	(32)	0,00
	Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,000	03.07.2023	37.100	(253)	(3)	0,00
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,400	03.07.2023	37.100	(253)	(1)	0,00
BRC	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,260	26.07.2023	25.600	(83)	(52)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,660	26.07.2023	25.600	(83)	(124)	0,00
	Call - OTC 7-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,350	27.07.2023	30.700	(71)	(59)	0,00
	Put - OTC 7-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,850	27.07.2023	30.700	(71)	(108)	0,00

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag[1]	Aufgeld	Markt-wert	% des Nettovermö-gens
CBK	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,690 %	02.04.2024	41.500	$ (326)	$ (49)	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,690	02.04.2024	41.500	(326)	(764)	0,00
GLM	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,765	25.07.2023	377.400	(2.359)	(10)	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,765	25.07.2023	377.400	(2.359)	(9.382)	(0,02)
	Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,468	25.07.2023	79.800	(1.907)	(8)	0,00
	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,468	25.07.2023	79.800	(1.907)	(5.016)	(0,01)
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,920	13.10.2023	96.700	(595)	(8)	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,920	13.10.2023	96.700	(595)	(2.075)	0,00
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,018	20.10.2023	77.900	(504)	(10)	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,018	20.10.2023	77.900	(504)	(1.586)	0,00
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,140	23.10.2023	77.500	(544)	(12)	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,140	23.10.2023	77.500	(544)	(1.487)	0,00
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,190	23.10.2023	77.500	(539)	(13)	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,190	23.10.2023	77.500	(539)	(1.451)	0,00
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,225	23.10.2023	77.500	(538)	(13)	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,225	23.10.2023	77.500	(538)	(1.426)	0,00
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,973	25.10.2023	77.700	(534)	(10)	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,973	25.10.2023	77.700	(534)	(1.611)	0,00
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,841	27.10.2023	77.400	(530)	(9)	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,841	27.10.2023	77.400	(530)	(1.688)	0,00
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,088	03.11.2023	77.800	(564)	(15)	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,088	03.11.2023	77.800	(564)	(1.503)	0,00
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,910	10.11.2023	78.600	(522)	(14)	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,910	10.11.2023	78.600	(522)	(1.632)	0,00
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,250	17.11.2023	155.600	(564)	(14)	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,750	17.11.2023	155.600	(564)	(2.024)	0,00
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,150	20.11.2023	155.600	(543)	(13)	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,650	20.11.2023	155.600	(543)	(2.156)	(0,01)
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,250	07.12.2023	159.200	(497)	(21)	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,750	07.12.2023	159.200	(497)	(1.993)	0,00
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,697	02.04.2024	249.100	(1.954)	(294)	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,697	02.04.2024	249.100	(1.954)	(4.569)	(0,01)
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,721	08.04.2024	80.600	(608)	(100)	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,721	08.04.2024	80.600	(608)	(1.446)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,260	26.07.2023	51.300	(167)	(103)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,660	26.07.2023	51.300	(167)	(248)	0,00
	Call - OTC 7-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,350	27.07.2023	30.700	(73)	(59)	0,00
	Put - OTC 7-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,850	27.07.2023	30.700	(73)	(108)	0,00
JPM	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,300	10.07.2023	28.600	(101)	(11)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,750	10.07.2023	28.600	(101)	(18)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,250	20.07.2023	64.100	(219)	(81)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,650	20.07.2023	64.100	(219)	(266)	0,00
MYC	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,050	19.07.2023	377.000	(2.262)	(7)	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,050	19.07.2023	377.000	(2.262)	(8.346)	(0,01)
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,052	20.07.2023	376.700	(2.317)	(9)	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,052	20.07.2023	376.700	(2.317)	(8.299)	(0,01)
	Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,700	19.07.2023	79.700	(1.857)	(6)	0,00
	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,700	19.07.2023	79.700	(1.857)	(4.210)	(0,01)
	Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,675	20.07.2023	81.100	(1.885)	(8)	0,00
	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,675	20.07.2023	81.100	(1.886)	(4.362)	(0,01)
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,993	11.10.2023	82.900	(560)	(16)	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,993	11.10.2023	82.900	(560)	(1.746)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,200	06.07.2023	30.200	(97)	0	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,650	06.07.2023	30.200	(97)	(32)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,300	10.07.2023	28.600	(99)	(11)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,750	10.07.2023	28.600	(99)	(18)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,270	24.07.2023	58.300	(193)	(104)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,670	24.07.2023	58.300	(193)	(240)	0,00
	Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,550	19.07.2023	20.300	(1.464)	(6)	0,00
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,550	19.07.2023	20.300	(1.464)	(2.397)	(0,01)
	Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,537	20.07.2023	20.300	(1.478)	(7)	0,00
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,537	20.07.2023	20.300	(1.478)	(2.443)	(0,01)
							$ (56.121)	$ (78.879)	(0,12)

ZINSCAPS

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag[1]	Aufgeld	Markt-wert	% des Nettovermögens
FAR	Call - OTC 2-Year Interest Rate Floor[2]	2-Year USD-LIBOR	0,022 %	08.08.2026	291.100	$ (5.021)	$ (9.419)	(0,02)
	Put - OTC 2-Year Interest Rate Floor[2]	2-Year USD-LIBOR	0,022	08.08.2026	291.100	(5.021)	(1.529)	0,00
MYC	Call - OTC 1-Year Interest Rate Floor[2]	1-Year USD-LIBOR	0,030	24.07.2024	869.400	(6.506)	(19.151)	(0,03)
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Floor[2]	1-Year USD-LIBOR	0,030	24.07.2024	869.400	(6.506)	(231)	0,00
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Floor[2]	1-Year USD-LIBOR	0,026	23.07.2025	869.400	(7.615)	(13.872)	(0,02)
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Floor[2]	1-Year USD-LIBOR	0,026	23.07.2025	869.400	(7.615)	(1.972)	0,00
	Call - OTC 2-Year Interest Rate Floor[2]	2-Year USD-LIBOR	0,026	23.07.2026	616.200	(10.898)	(17.481)	(0,03)
	Put - OTC 2-Year Interest Rate Floor[2]	2-Year USD-LIBOR	0,026	23.07.2026	616.200	(10.897)	(4.082)	(0,01)
						$ (60.079)	$ (67.737)	(0,11)

OPTIONEN AUF WERTPAPIERE

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungskurs	Verfallsdatum	Nennbetrag[1]	Aufgeld	Marktwert	% des Nettovermögens
MSC	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security. TBA 4,000 % fällig am 01.07.2053	$ 93,281	06.07.2023	18.600	$ (74)	$ (18)	0,00
SAL	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security. TBA 4,500 % fällig am 01.08.2053	95,875	07.08.2023	59.000	(350)	(344)	0,00
	Call - OTC Uniform Mortgage-Backed Security. TBA 4,500 % fällig am 01.08.2053	97,875	07.08.2023	59.000	(323)	(83)	0,00
					$ (747)	$ (445)	0,00

(1) Der Nennbetrag stellt die Anzahl der Kontrakte dar.

(2) Das zugrunde liegende Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft.

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMMISSIONEN - SCHUTZKAUF[1]

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu bezahlender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag[3]	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Marktwert	% des Nettovermögens
BOA	HSBC Holdings PLC	(1,000) %	20.06.2024	€ 1.300	$ 22	$ (29)	$ (7)	0,00
	UBS AG	(1,000)	20.06.2024	$ 19.300	1.254	(1.288)	(34)	0,00
BPS	UBS AG	(1,000)	20.06.2024	7.000	458	(471)	(13)	0,00
					$ 1.734	$ (1.788)	$ (54)	0,00

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMMISSIONEN - SCHUTZVERKAUF[2]

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeitsdatum	Nennbetrag[3]	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme)	Marktwert	% des Nettovermögens
BOA	South Africa Government International Bond	1,000 %	20.12.2026	$ 5.500	$ (241)	$ 47	$ (194)	0,00
	Turkey Government International Bond	1,000	20.12.2023	60.500	(4.393)	4.124	(269)	0,00
	Turkey Government International Bond	1,000	20.06.2024	10.800	(998)	786	(212)	0,00
	Turkey Government International Bond	1,000	20.12.2024	23.000	(2.501)	1.605	(896)	0,00
BPS	Colombia Government International Bond	1,000	20.06.2027	14.700	(705)	258	(447)	0,00
	Colombia Government International Bond	1,000	20.12.2027	2.900	(259)	131	(128)	0,00
	Turkey Government International Bond	1,000	20.12.2023	17.900	(1.564)	1.484	(80)	0,00
	Turkey Government International Bond	1,000	20.12.2024	4.000	(287)	131	(156)	0,00
	Turkey Government International Bond	1,000	20.06.2025	1.300	(223)	149	(74)	0,00
BRC	Turkey Government International Bond	1,000	20.06.2024	7.070	(658)	519	(139)	0,00
	Turkey Government International Bond	1,000	20.12.2024	84.600	(11.485)	8.189	(3.296)	(0,01)
BYL	Turkey Government International Bond	1,000	20.12.2023	22.450	(1.502)	1.402	(100)	0,00
	Turkey Government International Bond	1,000	20.12.2024	15.260	(1.322)	728	(594)	0,00
CBK	Brazil Government International Bond	1,000	20.12.2024	168.400	(2.908)	4.399	1.491	0,00
	Colombia Government International Bond	1,000	20.06.2024	10.000	(102)	148	46	0,00
	Colombia Government International Bond	1,000	20.12.2024	29.600	116	(31)	85	0,00
	Colombia Government International Bond	1,000	20.12.2026	42.900	(1.989)	1.098	(891)	0,00
	Colombia Government International Bond	1,000	20.06.2027	10.600	(381)	58	(323)	0,00
	Mexico Government International Bond	1,000	20.06.2024	52.400	(847)	1.269	422	0,00
	Mexico Government International Bond	1,000	20.06.2026	31.000	(203)	627	424	0,00
	Turkey Government International Bond	1,000	20.06.2024	12.600	(1.154)	906	(248)	0,00
	Turkey Government International Bond	1,000	20.12.2024	4.700	(490)	307	(183)	0,00
GST	Brazil Government International Bond	1,000	20.12.2024	176.800	(2.751)	4.316	1.565	0,01
	Colombia Government International Bond	1,000	20.12.2023	32.600	(488)	591	103	0,00
	Colombia Government International Bond	1,000	20.06.2027	17.600	(687)	151	(536)	0,00
	Colombia Government International Bond	1,000	20.12.2027	8.200	(731)	369	(362)	0,00
	Equinix, Inc.	5,000	20.06.2027	9.000	1.258	(103)	1.155	0,00
	Indonesia Government International Bond	1,000	20.06.2028	22.200	82	63	145	0,00
	Mexico Government International Bond	1,000	20.12.2024	60.300	(502)	1.141	639	0,00
	Mexico Government International Bond	1,000	20.12.2027	2.400	(101)	110	9	0,00
	Mexico Government International Bond	1,000	20.06.2028	10.500	(179)	169	(10)	0,00
	South Africa Government International Bond	1,000	20.12.2023	8.700	(449)	461	12	0,00
	South Africa Government International Bond	1,000	20.12.2025	10.200	(565)	392	(173)	0,00
	South Africa Government International Bond	1,000	20.12.2026	4.800	(215)	45	(170)	0,00
	Turkey Government International Bond	1,000	20.06.2024	37.500	(3.786)	3.049	(737)	0,00
	Turkey Government International Bond	1,000	20.12.2024	58.600	(6.583)	4.300	(2.283)	0,00
HUS	Brazil Government International Bond	1,000	20.12.2023	30.100	(953)	1.082	129	0,00
	Brazil Government International Bond	1,000	20.06.2024	187.100	(5.474)	6.873	1.399	0,00
	Colombia Government International Bond	1,000	20.06.2024	32.400	(94)	245	151	0,00
JPM	Colombia Government International Bond	1,000	20.12.2026	2.200	(101)	55	(46)	0,00
	Colombia Government International Bond	1,000	20.06.2027	3.500	(135)	28	(107)	0,00
	Mexico Government International Bond	1,000	20.06.2026	33.200	(259)	713	454	0,00
	South Africa Government International Bond	1,000	20.12.2023	37.600	(2.111)	2.163	52	0,00
	Turkey Government International Bond	1,000	20.12.2023	2.200	(151)	141	(10)	0,00
MBC	Turkey Government International Bond	1,000	20.12.2024	6.200	(676)	434	(242)	0,00
MYC	Colombia Government International Bond	1,000	20.06.2027	21.700	(781)	121	(660)	0,00
	Colombia Government International Bond	1,000	20.12.2027	24.900	(2.220)	1.120	(1.100)	0,00
	Mexico Government International Bond	1,000	20.12.2024	47.400	(418)	920	502	0,00
	Mexico Government International Bond	1,000	20.12.2025	5.300	(73)	144	71	0,00
	Mexico Government International Bond	1,000	20.06.2026	56.100	(326)	1.092	766	0,00
	Mexico Government International Bond	1,000	20.12.2026	44.400	68	426	494	0,00
	Mexico Government International Bond	1,000	20.06.2027	40.600	(137)	490	353	0,00
	Mexico Government International Bond	1,000	20.06.2028	97.700	(2.227)	2.132	(95)	0,00
	South Africa Government International Bond	1,000	20.12.2026	124.200	(5.441)	1.051	(4.390)	(0,01)
	Turkey Government International Bond	1,000	20.12.2023	12.500	(1.123)	1.067	(56)	0,00
	Turkey Government International Bond	1,000	20.06.2024	17.500	(1.945)	1.601	(344)	0,00
	Turkey Government International Bond	1,000	20.12.2024	4.600	(518)	339	(179)	0,00
					$ (74.888)	$ 65.625	$ (9.263)	(0,01)

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES - SCHUTZVERKAUF[2]

Kontrahent	Index/Tranchen	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag[3]	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Markt-wert	% des Nettovermö-gens
BOA	ABX.HE.AA.6-1 Index	0,320 %	25.07.2045	$ 704	$ (243)	$ 194	$ (49)	0,00
	ABX.HE.AAA.6-2 Index	0,110	25.05.2046	31.672	(8.014)	6.751	(1.263)	0,00
	CMBX.NA.AS.6 Index	1,000	11.05.2063	199	0	0	0	0,00
BRC	ABX.HE.AAA.6-2 Index	0,110	25.05.2046	2.491	(628)	529	(99)	0,00
	CMBX.NA.AAA.13 Index	0,500	16.12.2072	100.000	(1.840)	340	(1.500)	0,00
	CMBX.NA.AS.6 Index	1,000	11.05.2063	1.371	(47)	46	(1)	0,00
	PRIMEX.ARM.2-AAA Index	4,580	25.12.2037	204	9	(7)	2	0,00
CBK	CDX.HY-33 5-Year Index 35-100 %	5,000	20.12.2024	57.942	9.646	(5.556)	4.090	0,01
DUB	CMBX.NA.AAA.10 Index	0,500	17.11.2059	233.645	(4.705)	3.756	(949)	0,00
FBF	CMBX.NA.AAA.11 Index	0,500	18.11.2054	512.161	(3.542)	(30)	(3.572)	(0,01)
	CMBX.NA.AAA.12 Index	0,500	17.08.2061	162.200	(1.133)	(661)	(1.794)	0,00
GST	ABX.HE.AAA.6-2 Index	0,110	25.05.2046	817	(195)	162	(33)	0,00
	CMBX.NA.AAA.10 Index	0,500	17.11.2059	1.176.350	(15.149)	10.370	(4.779)	(0,01)
	CMBX.NA.AAA.11 Index	0,500	18.11.2054	912.039	2.357	(8.718)	(6.361)	(0,01)
	CMBX.NA.AAA.13 Index	0,500	16.12.2072	86.300	(1.494)	199	(1.295)	0,00
	CMBX.NA.AAA.15 Index	0,500	18.11.2064	473.700	(13.687)	1.126	(12.561)	(0,02)
JPS	CMBX.NA.AAA.10 Index	0,500	17.11.2059	171.400	(2.957)	2.261	(696)	0,00
	CMBX.NA.AAA.11 Index	0,500	18.11.2054	171.700	(1.351)	153	(1.198)	0,00
MEI	CMBX.NA.AAA.12 Index	0,500	17.08.2061	45.500	(336)	(167)	(503)	0,00
MYC	CDX.HY-33 5-Year Index 35-100 %	5,000	20.12.2024	117.250	19.538	(11.260)	8.278	0,01
	CMBX.NA.AAA.10 Index	0,500	17.11.2059	66.700	(1.419)	1.148	(271)	0,00
	CMBX.NA.AAA.11 Index	0,500	18.11.2054	364.800	(3.092)	547	(2.545)	(0,01)
	CMBX.NA.AAA.12 Index	0,500	17.08.2061	923.900	(14.119)	3.901	(10.218)	(0,02)
	CMBX.NA.AAA.13 Index	0,500	16.12.2072	379.100	507	(6.194)	(5.687)	(0,01)
	CMBX.NA.AAA.14 Index	0,500	16.12.2072	171.300	(4.147)	610	(3.537)	(0,01)
	CMBX.NA.AAA.15 Index	0,500	18.11.2064	74.400	(631)	(1.342)	(1.973)	0,00
	CMBX.NA.AS.6 Index	1,000	11.05.2063	119	(4)	4	0	0,00
SAL	CMBX.NA.AAA.10 Index	0,500	17.11.2059	810.495	(7.907)	4.615	(3.292)	(0,01)
	CMBX.NA.AAA.11 Index	0,500	18.11.2054	152.400	(785)	(278)	(1.063)	0,00
	CMBX.NA.AAA.12 Index	0,500	17.08.2061	1.386.500	(13.793)	(1.541)	(15.334)	(0,02)
	CMBX.NA.AAA.13 Index	0,500	16.12.2072	88.800	0	(1.332)	(1.332)	0,00
UAG	CMBX.NA.AAA.10 Index	0,500	17.11.2059	15.500	(445)	382	(63)	0,00
					$ (69.606)	$ 8	$ (69.598)	(0,11)

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

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

(3) Der maximal mögliche Betrag, den der Fonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung		Zu erhaltende Währung		Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
AZD	07.2023	AUD	213.693	$	141.807	$ 0	$ (438)	$ (438)	0,00
	07.2023	$	25.308	AUD	38.671	433	0	433	0,00
	08.2023		141.919		213.693	439	0	439	0,00
BOA	07.2023	BRL	1.092.872	$	227.682	1.133	0	1.133	0,00
	07.2023	CAD	50.220		36.908	0	(1.044)	(1.044)	0,00
	07.2023	DKK	47.744		7.022	26	0	26	0,00
	07.2023	€	2.892.903		3.109.146	13	(47.026)	(47.013)	(0,07)
	07.2023	£	1.889		2.402	1	0	1	0,00
	07.2023	KRW	21.404.093		16.374	109	0	109	0,00
	07.2023	$	239.615	AUD	367.256	4.849	0	4.849	0,01
	07.2023		649	CLP	518.135	0	(5)	(5)	0,00
	07.2023		426	CNH	3.027	0	(10)	(10)	0,00
	07.2023		3.802	DKK	26.327	56	0	56	0,00
	07.2023		15.458	€	14.291	134	0	134	0,00
	07.2023		51.760	£	40.973	331	0	331	0,00
	07.2023		253.509	MXN	4.667.108	17.934	0	17.934	0,03
	07.2023		83.019	NZD	136.836	813	0	813	0,00
	08.2023	¥	30.501.508	$	221.212	8.429	0	8.429	0,01
	08.2023	$	226.521	BRL	1.092.872	0	(1.073)	(1.073)	0,00
	08.2023		7.022	DKK	47.665	0	(26)	(26)	0,00
	08.2023		390	MXN	7.203	27	0	27	0,00
	08.2023		12.844	ZAR	234.981	0	(459)	(459)	0,00
	09.2023	¥	39.652.000	$	285.475	7.888	0	7.888	0,01
	09.2023	TWD	863.392		28.441	662	0	662	0,00
	09.2023	$	931	HKD	7.275	0	(1)	(1)	0,00
	09.2023		105.297	IDR	1.576.294.578	0	(600)	(600)	0,00
	09.2023		132.840	KRW	168.303.768	0	(4.569)	(4.569)	(0,01)

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung		Zu erhaltende Währung		Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BPS	07.2023	AUD	153.451	$	101.641	$ 0	$ (503)	$ (503)	0,00
	07.2023	BRL	168.074		35.015	174	0	174	0,00
	07.2023	CAD	499.877		376.836	0	(929)	(929)	0,00
	07.2023	CHF	246		272	0	(4)	(4)	0,00
	07.2023	€	3.722		4.057	0	(3)	(3)	0,00
	07.2023	£	398		493	0	(14)	(14)	0,00
	07.2023	¥	7.371.900		52.044	1.039	0	1.039	0,00
	07.2023	KRW	3.203.677		2.451	17	0	17	0,00
	07.2023	PEN	82.193		22.546	0	(117)	(117)	0,00
	07.2023	SGD	187		140	2	0	2	0,00
	07.2023	$	4.060	AUD	6.168	45	0	45	0,00
	07.2023		4.216	CHF	3.771	0	(1)	(1)	0,00
	07.2023		20.507	CLP	16.201.315	0	(332)	(332)	0,00
	07.2023		26.343	€	24.142	25	(29)	(4)	0,00
	07.2023		38.885	£	30.363	1	(284)	(283)	0,00
	07.2023		278	HKD	2.178	0	0	0	0,00
	07.2023		1.151.501	¥	159.985.622	0	(44.604)	(44.604)	(0,07)
	08.2023	CHF	3.760	$	4.216	1	0	1	0,00
	08.2023	CNH	8.475		1.227	58	0	58	0,00
	08.2023	COP	20.000.000		4.360	0	(354)	(354)	0,00
	08.2023	KRW	213.185.465		162.578	579	(19)	560	0,00
	08.2023	TWD	432.158		14.155	276	0	276	0,00
	08.2023	$	101.721	AUD	153.451	505	0	505	0,00
	08.2023		34.837	BRL	168.074	0	(165)	(165)	0,00
	08.2023		135.610	INR	11.141.683	48	(8)	40	0,00
	08.2023		22.511	PEN	82.193	107	0	107	0,00
	08.2023	ZAR	229.830	$	12.435	318	0	318	0,00
	09.2023	$	118.895	IDR	1.786.694.261	0	(217)	(217)	0,00
	09.2023		528	ZAR	9.322	0	(38)	(38)	0,00
	10.2023	ZAR	522.082	$	28.114	770	0	770	0,00
BRC	07.2023	£	6.757		8.512	0	(79)	(79)	0,00
	07.2023	¥	15.387.000		118.964	12.298	0	12.298	0,02
	07.2023	KRW	21.587.029		16.519	115	0	115	0,00
	07.2023	NZD	78.426		47.799	0	(249)	(249)	0,00
	07.2023	SGD	15		11	0	0	0	0,00
	07.2023	$	38.034	£	30.440	701	(35)	666	0,00
	07.2023		1.937	NZD	3.227	40	0	40	0,00
	08.2023	CNH	131	$	18	0	0	0	0,00
	08.2023	$	1.646	MXN	28.479	1	0	1	0,00
	08.2023	ZAR	894.917	$	46.825	193	(535)	(342)	0,00
	09.2023	IDR	3.139.928		210	1	0	1	0,00
	09.2023	ILS	64		18	1	0	1	0,00
	09.2023	¥	27.972.000		204.352	8.969	0	8.969	0,01
CBK	07.2023	AUD	10.499		7.024	35	0	35	0,00
	07.2023	BRL	394.739		82.540	712	0	712	0,00
	07.2023	£	13.976		17.721	0	(47)	(47)	0,00
	07.2023	IDR	417.441		28	0	0	0	0,00
	07.2023	MXN	49.303		2.733	0	(135)	(135)	0,00
	07.2023	PEN	127.411		35.084	0	(66)	(66)	0,00
	07.2023	$	89.474	AUD	137.137	1.811	0	1.811	0,00
	07.2023		400.000	BRL	2.135.280	42.638	0	42.638	0,07
	07.2023		100.194	CLP	80.278.146	251	(477)	(226)	0,00
	07.2023		3.115.519	€	2.865.917	11.223	(26)	11.197	0,02
	07.2023		50.484	£	39.884	280	(58)	222	0,00
	07.2023		28	IDR	417.441	0	0	0	0,00
	07.2023		320	MXN	5.671	10	0	10	0,00
	07.2023		34.291	PEN	127.411	859	0	859	0,00
	08.2023	€	2.817.994	$	3.068.045	0	(10.597)	(10.597)	(0,02)
	08.2023	¥	71.217.564		516.797	19.973	0	19.973	0,03
	08.2023	SEK	15.788		1.557	92	0	92	0,00
	08.2023	TWD	449.925		14.739	290	0	290	0,00
	08.2023	$	437.502	BRL	2.199.716	16.948	(673)	16.275	0,03
	08.2023		63.477	CLP	51.055.978	1	(108)	(107)	0,00
	08.2023		466	CNH	3.248	0	(18)	(18)	0,00
	08.2023		534	MXN	9.251	1	0	1	0,00
	08.2023		114.988	NOK	1.199.469	0	(2.860)	(2.860)	0,00
	09.2023	IDR	417.955	$	28	0	0	0	0,00
	09.2023	KRW	21.517.513		16.645	246	0	246	0,00
	09.2023	$	1.902	BRL	9.226	0	(10)	(10)	0,00
	10.2023		14.756	CLP	11.980.971	1	0	1	0,00
	10.2023		200.000	MXN	3.916.040	23.930	0	23.930	0,04
DUB	07.2023	PEN	158.620	$	43.368	0	(391)	(391)	0,00
	07.2023	$	1.833	MXN	31.671	11	(1)	10	0,00
	07.2023		87.024	PEN	317.240	473	0	473	0,00
	09.2023	IDR	1.238.338	$	83	0	0	0	0,00

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung		Zu erhaltende Währung		Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
	10.2023	ZAR	2.514.760	$	138.092	$ 6.359	$ 0	$ 6.359	0,01
FAR	07.2023	SGD	188		139	0	0	0	0,00
GLM	07.2023	BRL	1.354.467		281.902	1.125	0	1.125	0,00
	07.2023	KRW	8.481.662		6.489	44	0	44	0,00
	07.2023	PEN	31.209		8.594	0	(16)	(16)	0,00
	07.2023	SGD	202		150	0	0	0	0,00
	07.2023	$	400.000	BRL	2.015.920	17.895	0	17.895	0,03
	07.2023		44.567	MXN	781.574	926	0	926	0,00
	07.2023		8.419	PEN	31.209	191	0	191	0,00
	08.2023	KRW	101.892.293	$	77.472	40	(5)	35	0,00
	08.2023	$	481.902	BRL	2.420.037	18.083	(756)	17.327	0,03
	08.2023		209.090	INR	17.176.866	48	(10)	38	0,00
	08.2023		50.557	NOK	536.418	0	(412)	(412)	0,00
	09.2023		193.351	BRL	985.646	8.700	0	8.700	0,01
	10.2023		200.000		978.170	0	(428)	(428)	0,00
	10.2023	ZAR	1.302.045	$	69.404	1.210	0	1.210	0,00
	12.2023	$	100.000	MXN	1.976.800	11.841	0	11.841	0,02
IND	07.2023		106	CHF	95	0	0	0	0,00
	07.2023		11.168	DKK	77.371	169	0	169	0,00
	08.2023	CHF	95	$	106	0	0	0	0,00
	08.2023	CNH	3.096		437	10	0	10	0,00
	08.2023	$	129.819	NOK	1.360.581	0	(2.629)	(2.629)	0,00
	09.2023	SGD	160	$	120	1	0	1	0,00
	10.2023	$	50.000	CLP	40.510.000	0	(105)	(105)	0,00
JPM	07.2023	BRL	159.689	$	33.352	249	0	249	0,00
	07.2023	€	9.700		10.371	0	(212)	(212)	0,00
	07.2023	¥	52.876.771		369.735	3.895	0	3.895	0,01
	07.2023	SGD	21		16	0	0	0	0,00
	07.2023	$	199.512	AUD	305.169	3.624	0	3.624	0,01
	07.2023		2.887.881	£	2.283.993	15.875	0	15.875	0,02
	07.2023		47.793	NZD	78.426	254	0	254	0,00
	07.2023		3.095	SGD	4.089	0	(72)	(72)	0,00
	08.2023	CNH	6.803	$	984	46	0	46	0,00
	08.2023	£	2.283.993		2.888.493	0	(15.844)	(15.844)	(0,02)
	08.2023	¥	44.860.928		325.232	12.275	0	12.275	0,02
	08.2023	KRW	17.967.504		13.620	0	(35)	(35)	0,00
	08.2023	NZD	78.426		47.789	0	(253)	(253)	0,00
	08.2023	$	33.178	BRL	159.689	0	(236)	(236)	0,00
	08.2023		369.735	¥	52.652.083	0	(3.909)	(3.909)	(0,01)
	08.2023		4.258	MXN	73.786	9	0	9	0,00
	08.2023		18.647	NOK	197.799	0	(156)	(156)	0,00
	08.2023		6.321	ZAR	115.680	0	(222)	(222)	0,00
	08.2023	ZAR	1.103	$	60	2	0	2	0,00
	09.2023	ILS	61		17	1	0	1	0,00
	09.2023	INR	48.517		589	0	(1)	(1)	0,00
	09.2023	KRW	59.788.491		45.977	410	0	410	0,00
	09.2023	$	43.890	IDR	660.353.220	0	(27)	(27)	0,00
	09.2023		155.203	PEN	571.459	1.504	0	1.504	0,00
	09.2023		7.527	SGD	10.067	0	(67)	(67)	0,00
	10.2023	MXN	25.116	$	1.430	0	(6)	(6)	0,00
	12.2023	$	142.392	INR	11.750.563	0	(48)	(48)	0,00
MBC	07.2023	CAD	588	$	446	1	0	1	0,00
	07.2023	€	49.858		53.381	0	(1.014)	(1.014)	0,00
	07.2023	£	5.419		6.753	0	(136)	(136)	0,00
	07.2023	HKD	210		27	0	0	0	0,00
	07.2023	¥	18.330.650		140.245	13.061	0	13.061	0,02
	07.2023	$	1.219	CAD	1.624	9	0	9	0,00
	07.2023		57.554	€	53.577	898	0	898	0,00
	07.2023		3.220	£	2.518	0	(18)	(18)	0,00
	07.2023		16.598	¥	2.307.528	0	(633)	(633)	0,00
	08.2023	CNH	18	$	3	0	0	0	0,00
	08.2023	$	1.042	¥	150.015	0	0	0	0,00
	09.2023	¥	76.717.000	$	558.840	22.465	0	22.465	0,04
	09.2023	SGD	250		185	0	0	0	0,00
	09.2023	$	244.638	KRW	311.986.429	0	(6.861)	(6.861)	(0,01)
	09.2023		1.492	ZAR	26.404	0	(105)	(105)	0,00
	09.2023	ZAR	2.863.258	$	158.281	7.762	0	7.762	0,01
MYI	07.2023	AUD	1.999		1.320	0	(11)	(11)	0,00
	07.2023	CHF	8		9	0	0	0	0,00
	07.2023	DKK	42.580		6.242	3	0	3	0,00
	07.2023	€	4.088		4.443	0	(17)	(17)	0,00
	07.2023	£	2.441.459		3.034.406	0	(69.547)	(69.547)	(0,11)
	07.2023	HKD	3.038		388	0	0	0	0,00
	07.2023	IDR	415.530.265		27.785	69	0	69	0,00
	07.2023	¥	208.879		1.450	4	0	4	0,00
	07.2023	SGD	106		78	0	0	0	0,00
	07.2023	$	6	CHF	6	0	0	0	0,00
	07.2023		13.002	€	11.973	61	0	61	0,00
	07.2023		21.457	£	17.100	295	(12)	283	0,00
	07.2023		27.654	IDR	415.530.265	62	0	62	0,00
	07.2023		1.442	MXN	24.667	0	(6)	(6)	0,00
	07.2023		5.499	NZD	9.086	67	0	67	0,00
	08.2023	CNH	54	$	8	0	0	0	0,00
	08.2023	TWD	2.979.497		97.795	2.111	0	2.111	0,00
	08.2023	$	6.242	DKK	42.509	0	(3)	(3)	0,00
	08.2023		13.995	ZAR	256.162	0	(491)	(491)	0,00
	09.2023	INR	10.479	$	127	0	0	0	0,00
	09.2023	KRW	115.786.160		89.152	907	0	907	0,00
	09.2023	$	92.368	IDR	1.380.399.373	0	(677)	(677)	0,00
	09.2023		273.981	KRW	350.622.323	0	(6.759)	(6.759)	(0,01)

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung		Zu erhaltende Währung		Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
RBC	07.2023	AUD	8.679	$	5.907	$ 130	$ 0	$ 130	0,00
	07.2023	$	23.907	£	18.701	0	(131)	(131)	0,00
	07.2023		98.948	MXN	1.903.869	11.869	0	11.869	0,02
	08.2023	CNH	17	$	2	0	0	0	0,00
	08.2023	MXN	1.127.071		65.036	0	(151)	(151)	0,00
RYL	07.2023	€	1.678		1.808	0	(23)	(23)	0,00
	07.2023	$	1.337	€	1.244	21	0	21	0,00
	08.2023	CNH	228	$	32	1	0	1	0,00
SCX	07.2023	AUD	313.874		208.362	0	(568)	(568)	0,00
	07.2023	CHF	4.869		5.419	0	(23)	(23)	0,00
	07.2023	£	182		229	0	(2)	(2)	0,00
	07.2023	$	281.491	AUD	430.779	5.257	0	5.257	0,01
	07.2023		1.631	CHF	1.472	15	0	15	0,00
	07.2023		2.025	£	1.611	23	0	23	0,00
	07.2023		216.376	NZD	356.375	1.958	0	1.958	0,00
	08.2023	CNH	9.131	$	1.329	70	0	70	0,00
	08.2023	TWD	2.858.469		93.610	1.812	0	1.812	0,00
	08.2023	$	208.527	AUD	313.874	570	0	570	0,00
	09.2023	INR	30.343	$	368	0	0	0	0,00
	09.2023	KRW	21.299.463		16.478	245	0	245	0,00
	09.2023	TWD	1.829.480		60.356	1.492	0	1.492	0,00
	09.2023	$	266.068	IDR	3.979.243.703	0	(1.753)	(1.753)	0,00
	09.2023	ZAR	2.911.476	$	165.943	13.000	0	13.000	0,02
SOG	07.2023	SGD	1.011		757	9	0	9	0,00
	07.2023	$	167.144	AUD	255.470	2.910	0	2.910	0,00
	07.2023		610	MXN	10.505	1	0	1	0,00
SSB	07.2023	BRL	981.358	$	205.305	1.873	0	1.873	0,00
	07.2023	¥	6.905.000		52.360	4.398	0	4.398	0,01
	07.2023	KRW	15.865.393		12.136	80	0	80	0,00
	07.2023	PEN	40.902		11.214	0	(64)	(64)	0,00
	08.2023	$	58.419	CLP	47.366.236	420	0	420	0,00
	08.2023		11.198	PEN	40.902	58	0	58	0,00
	09.2023		205.305	BRL	992.239	0	(1.902)	(1.902)	0,00
	12.2023		14.516	INR	1.198.078	0	(3)	(3)	0,00
TOR	07.2023	AUD	386.268	$	255.130	0	(1.989)	(1.989)	0,00
	07.2023	NZD	919.425		559.622	0	(3.664)	(3.664)	(0,01)
	07.2023	$	88.423	AUD	135.193	1.568	0	1.568	0,00
	07.2023		28.649	CAD	37.874	0	(27)	(27)	0,00
	07.2023		13.271	CLP	10.677.797	26	0	26	0,00
	08.2023	CAD	37.859	$	28.649	27	0	27	0,00
	08.2023	$	255.338	AUD	386.268	1.987	0	1.987	0,00
	08.2023		307.832	NZD	505.524	1.840	0	1.840	0,00
	09.2023	¥	37.377.000	$	265.270	3.359	0	3.359	0,01
UAG	07.2023	AUD	615.721		411.139	2.143	(859)	1.284	0,00
	07.2023	CHF	317		353	0	(2)	(2)	0,00
	07.2023	¥	21.417.510		148.480	298	0	298	0,00
	07.2023	$	20.259	AUD	30.946	340	0	340	0,00
	07.2023		104	CHF	93	0	0	0	0,00
	07.2023		1.756	MXN	31.255	64	0	64	0,00
	08.2023	CHF	93	$	104	0	0	0	0,00
	08.2023	TWD	5.284		172	3	0	3	0,00
	08.2023	$	411.463	AUD	615.721	858	(2.140)	(1.282)	0,00
	08.2023		1.021	CNH	7.080	0	(45)	(45)	0,00
	08.2023		148.480	¥	21.327.249	0	(299)	(299)	0,00
	08.2023	ZAR	528.356	$	27.528	8	(329)	(321)	0,00
	09.2023	SGD	10.128		7.579	73	0	73	0,00
	10.2023	ZAR	810.416		43.773	1.320	0	1.320	0,00
						$ 402.033	$ (244.950)	$ 157.083	0,24

ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklassen Institutional AUD (Hedged) thesaurierend, Investor AUD (Hedged) ausschüttend, Administrative AUD (Hedged) ausschüttend, Class E AUD (Hedged) ausschüttend und Class Z AUD (Hedged) ausschüttend II die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung		Zu erhaltende Währung		Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
AZD	07.2023	AUD	142.486	$	94.554	$ 0	$ (292)	$ (292)	0,00
	07.2023	$	181.023	AUD	276.642	3.123	0	3.123	0,00
	08.2023		94.628		142.486	293	0	293	0,00
BOA	07.2023	AUD	5.090	$	3.429	45	(3)	42	0,00
	07.2023	$	548.809	AUD	844.643	13.428	0	13.428	0,02
BPS	07.2023	AUD	791.945	$	524.092	6	(3.073)	(3.067)	0,00
	07.2023	$	27.205	AUD	41.197	294	(76)	218	0,00
	08.2023		490.001		739.189	2.433	0	2.433	0,00
CBK	07.2023	AUD	6.862	$	4.659	91	0	91	0,00
	07.2023	$	114.677	AUD	175.699	2.302	(25)	2.277	0,00
JPM	07.2023		173.071		264.725	3.143	0	3.143	0,01
MBC	07.2023	AUD	1.034	$	682	0	(6)	(6)	0,00
	07.2023	$	676	AUD	1.012	0	(2)	(2)	0,00
MYI	07.2023	AUD	239	$	160	1	0	1	0,00

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
RBC	07.2023	$ 2.744	AUD 4.091	$ 22	$ (43)	$ (21)	0,00
SCX	07.2023	AUD 251.342	$ 166.851	0	(455)	(455)	0,00
	07.2023	$ 140.802	AUD 215.394	2.585	(10)	2.575	0,00
	08.2023	166.983	251.342	456	0	456	0,00
TOR	07.2023	AUD 438.850	$ 289.861	0	(2.260)	(2.260)	0,00
	07.2023	$ 291.092	AUD 445.062	5.163	0	5.163	0,01
	08.2023	290.097	438.850	2.257	0	2.257	0,00
UAG	07.2023	AUD 851.261	$ 565.239	1.092	(2.494)	(1.402)	0,00
	07.2023	$ 212.567	AUD 324.703	3.572	0	3.572	0,01
	08.2023	564.773	849.912	2.497	(1.075)	1.422	0,00
				$ 42.803	$ (9.814)	$ 32.989	0,05

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklasse Institutional BRL (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2023	$ 109.069	BRL 544.314	$ 3.766	$ 0	$ 3.766	0,01
BPS	07.2023	BRL 275.714	$ 57.657	546	(43)	503	0,00
	07.2023	$ 52.327	BRL 261.027	1.783	0	1.783	0,00
	08.2023	56.683	272.175	0	(536)	(536)	0,00
CBK	07.2023	BRL 510.099	$ 106.469	903	(176)	727	0,00
	07.2023	$ 47.727	BRL 238.973	1.811	0	1.811	0,00
	08.2023	103.227	496.204	0	(866)	(866)	0,00
GLM	07.2023	45.344	227.206	1.755	0	1.755	0,00
JPM	07.2023	BRL 239.272	$ 49.886	343	(57)	286	0,00
	07.2023	$ 49.272	BRL 246.620	1.852	0	1.852	0,01
	08.2023	BRL 604	$ 124	0	(1)	(1)	0,00
	08.2023	$ 45.382	BRL 218.435	0	(322)	(322)	0,00
MBC	08.2023	4.472	21.488	0	(39)	(39)	0,00
TOR	07.2023	BRL 493.055	$ 102.773	565	0	565	0,00
	08.2023	$ 102.237	BRL 493.055	0	(525)	(525)	0,00
				$ 13.324	$ (2.565)	$ 10.759	0,02

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklassen Institutional CAD (Hedged) thesaurierend und Institutional CAD (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2023	CAD 1.701	$ 1.287	$ 1	$ 0	$ 1	0,00
	07.2023	$ 49.183	CAD 66.923	1.391	0	1.391	0,01
CBK	07.2023	2.425	3.305	72	0	72	0,00
JPM	07.2023	49.354	66.956	1.246	0	1.246	0,00
MBC	07.2023	CAD 2.100	$ 1.549	0	(37)	(37)	0,00
	07.2023	$ 1.098	CAD 1.446	2	(7)	(5)	0,00
MYI	07.2023	CAD 643	$ 485	0	(1)	(1)	0,00
SCX	07.2023	$ 49.515	CAD 67.248	1.305	0	1.305	0,00
TOR	07.2023	CAD 120.226	$ 90.741	38	(153)	(115)	0,00
	08.2023	$ 90.741	CAD 120.178	153	(37)	116	0,00
				$ 4.208	$ (235)	$ 3.973	0,01

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklassen Institutional CHF (Hedged) thesaurierend, Institutional CHF (Hedged) ausschüttend, Class E CHF (Hedged) thesaurierend und Class E CHF (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2023	CHF 9	$ 10	$ 0	$ 0	$ 0	0,00
	07.2023	$ 166	CHF 149	0	0	0	0,00
BPS	07.2023	CHF 199.684	$ 223.269	74	(4)	70	0,00
	07.2023	$ 296.735	CHF 268.459	3.336	0	3.336	0,01
	08.2023	222.609	198.524	0	(75)	(75)	0,00
IND	07.2023	CHF 105.227	$ 117.145	0	(472)	(472)	0,00
	08.2023	$ 117.145	CHF 104.928	472	0	472	0,00
JPM	07.2023	CHF 195	$ 215	0	(2)	(2)	0,00
MBC	07.2023	1.827	2.033	0	(9)	(9)	0,00
	07.2023	$ 2.210	CHF 1.985	9	0	9	0,00
MYI	07.2023	CHF 7.783	$ 8.598	0	(102)	(102)	0,00
	07.2023	$ 110	CHF 98	0	0	0	0,00
RBC	07.2023	CHF 101	$ 113	0	0	0	0,00
RYL	07.2023	481	535	0	(2)	(2)	0,00
SCX	07.2023	511	566	0	(5)	(5)	0,00
	07.2023	$ 211.312	CHF 189.869	916	0	916	0,00
UAG	07.2023	CHF 205.721	$ 229.492	0	(454)	(454)	0,00
	07.2023	$ 191.473	CHF 172.045	831	0	831	0,00
	08.2023	229.299	204.962	451	0	451	0,00
				$ 6.089	$ (1.125)	$ 4.964	0,01

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklassen Institutional EUR (Hedged) thesaurierend, Institutional EUR (Hedged) ausschüttend, Institutional EUR (Hedged) ausschüttend II, Investor EUR (Hedged) thesaurierend, Investor EUR (Hedged) ausschüttend, Investor EUR (Hedged) ausschüttend A, Administrative EUR (Hedged) thesaurierend, Administrative EUR (Hedged) ausschüttend, E Class EUR (Hedged) thesaurierend, E Class EUR (Hedged) ausschüttend, E Class EUR (Hedged) ausschüttend II, E Class EUR (Hedged) ausschüttend II Q, G Retail EUR (Hedged) ausschüttend, R Class EUR (Hedged) ausschüttend, T Class EUR (Hedged) thesaurierend und T Class EUR (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2023	$ 5.539.572	€ 5.154.449	$ 83.940	$ (6)	$ 83.934	0,14
BPS	07.2023	€ 5.241.939	$ 5.743.533	24.584	(8)	24.576	0,04
	07.2023	$ 5.555.993	€ 5.167.844	82.265	(139)	82.126	0,13
	08.2023	5.739.183	5.230.568	0	(24.818)	(24.818)	(0,04)
CBK	07.2023	€ 5.314.554	$ 5.774.992	0	(23.188)	(23.188)	(0,04)
	07.2023	$ 11.003	€ 10.073	14	(27)	(13)	0,00
	08.2023	5.548.601	5.096.379	19.164	0	19.164	0,03
JPM	07.2023	€ 5.241.978	$ 5.723.716	4.716	0	4.716	0,01
	07.2023	$ 320.901	€ 300.141	6.553	0	6.553	0,01
	08.2023	5.731.721	5.241.978	0	(4.889)	(4.889)	(0,01)
MBC	07.2023	€ 46.018	$ 49.593	27	(640)	(613)	0,00
	07.2023	$ 63.244	€ 58.317	462	(82)	380	0,00
MYI	07.2023	9.346	8.614	51	0	51	0,00
SOG	07.2023	5.532.365	5.142.849	78.484	0	78.484	0,12
				$ 300.260	$ (53.797)	$ 246.463	0,39

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklassen Institutional GBP (Hedged) thesaurierend, Institutional GBP (Hedged) ausschüttend, Investor GBP (Hedged) ausschüttend, Administrative GBP (Hedged) ausschüttend, Class E GBP (Hedged) ausschüttend und Class R GBP (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2023	$ 9.474	£ 7.464	$ 18	$ (3)	$ 15	0,00
BPS	07.2023	£ 974	$ 1.248	10	0	10	0,00
	07.2023	$ 434.812	£ 351.538	12.115	0	12.115	0,02
BRC	07.2023	£ 7.159	$ 8.959	0	(143)	(143)	0,00
	07.2023	$ 1.265	£ 1.000	8	(1)	7	0,00
CBK	07.2023	£ 2.601	$ 3.286	0	(21)	(21)	0,00
	07.2023	$ 40.201	£ 31.592	22	(58)	(36)	0,00
JPM	07.2023	£ 364.569	$ 460.961	0	(2.534)	(2.534)	0,00
	08.2023	$ 461.059	£ 364.569	2.529	0	2.529	0,00
MBC	07.2023	439.868	355.209	11.750	(23)	11.727	0,02
MYI	07.2023	431.151	346.901	9.883	0	9.883	0,01
TOR	07.2023	£ 364.830	$ 463.590	0	(237)	(237)	0,00
	08.2023	$ 463.691	£ 364.830	229	0	229	0,00
				$ 36.564	$ (3.020)	$ 33.544	0,05

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklassen Institutional JPY (Hedged) thesaurierend, Investor JPY (Hedged) thesaurierend, E Class JPY (Hedged) thesaurierend und E Class JPY (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
AZD	07.2023	$ 141	¥ 19.630	$ 0	$ (5)	$ (5)	0,00
BOA	07.2023	24.410	3.393.259	0	(933)	(933)	0,00
BRC	07.2023	1.055	151.776	0	(4)	(4)	0,00
CBK	07.2023	11.669	1.638.095	0	(336)	(336)	0,00
DUB	07.2023	2.748	383.597	0	(94)	(94)	0,00
MBC	07.2023	¥ 3.575.966	$ 24.767	26	0	26	0,00
	07.2023	$ 10.427	¥ 1.456.723	0	(348)	(348)	0,00
	08.2023	24.767	3.560.848	0	(27)	(27)	0,00
MYI	07.2023	6.459	902.963	0	(212)	(212)	0,00
RYL	07.2023	¥ 284.515	$ 2.045	77	0	77	0,00
	07.2023	$ 173	¥ 24.165	0	(6)	(6)	0,00
SCX	07.2023	24.902	3.464.161	0	(935)	(935)	0,00
				$ 103	$ (2.900)	$ (2.797)	0,00

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklasse Institutional NOK (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2023	NOK 4.462	$ 411	$ 0	$ (5)	$ (5)	0,00
	07.2023	$ 140.743	NOK 1.564.935	5.328	0	5.328	0,01
CBK	07.2023	NOK 31.270	$ 2.815	0	(104)	(104)	0,00
	07.2023	$ 68.872	NOK 774.477	3.417	0	3.417	0,01
GLM	07.2023	NOK 636.799	$ 59.081	0	(358)	(358)	(0,01)
	08.2023	$ 59.062	NOK 635.974	360	0	360	0,00
MBC	07.2023	NOK 242	$ 23	0	0	0	0,00
MYI	07.2023	2.931	270	0	(3)	(3)	0,00
RYL	07.2023	4.976	462	0	(3)	(3)	0,00
SCX	07.2023	104	10	0	0	0	0,00
				$ 9.105	$ (473)	$ 8.632	0,01

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklassen Investor RMB (Hedged) thesaurierend und Class E RMB (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung		Zu erhaltende Währung		Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2023	$	33.616	CNH	238.750	$ 0	$ (797)	$ (797)	0,00
BPS	07.2023		33.699		238.605	0	(900)	(900)	0,00
BRC	07.2023		142		999	0	(4)	(4)	0,00
GLM	07.2023	CNH	260.830	$	35.958	104	0	104	0,00
	07.2023	$	33.897	CNH	239.120	0	(1.028)	(1.028)	(0,01)
	08.2023		35.958		260.233	0	(109)	(109)	0,00
IND	07.2023		3.444		24.689	0	(51)	(51)	0,00
MBC	07.2023	CNH	1.391	$	195	4	0	4	0,00
	07.2023	$	3.174	CNH	22.602	0	(67)	(67)	0,00
SOG	07.2023		42		302	0	0	0	0,00
UAG	07.2023		1.383		9.878	0	(25)	(25)	0,00
						$ 108	$ (2.981)	$ (2.873)	(0,01)

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklassen Institutional SGD (Hedged) thesaurierend, Institutional SGD (Hedged) ausschüttend, Investor SGD (Hedged) thesaurierend, Investor SGD (Hedged) ausschüttend, Administrative SGD (Hedged) ausschüttend und Class E SGD (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung		Zu erhaltende Währung		Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BRC	07.2023	$	1.203.525	SGD	1.628.515	$ 0	$ (203)	$ (203)	0,00
GLM	07.2023	SGD	29.937	$	22.295	174	0	174	0,00
	07.2023	$	94.561	SGD	127.132	0	(623)	(623)	0,00
JPM	07.2023	SGD	1.796.588	$	1.327.659	147	0	147	0,00
	07.2023	$	240.098	SGD	324.957	15	0	15	0,00
	08.2023		1.327.659		1.794.862	0	(104)	(104)	0,00
MBC	07.2023		1.169.359		1.579.966	2	(1.913)	(1.911)	(0,01)
	08.2023		13.614		18.390	0	(12)	(12)	0,00
MYI	07.2023	SGD	1.747.700	$	1.293.388	2.024	(24)	2.000	0,00
	07.2023	$	237	SGD	321	0	0	0	0,00
	08.2023		1.274.199		1.720.131	0	(1.918)	(1.918)	0,00
UAG	07.2023		1.286.081		1.739.540	0	(722)	(722)	0,00
						$ 2.362	$ (5.519)	$ (3.157)	(0,01)
Summe Freiverkehrsfinanzderivate								**$ 390.663**	**0,61**

LEERVERKAUFTE WERTPAPIERE

BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
US-REGIERUNGSBEHÖRDEN			
Ginnie Mae, TBA			
2,500 % fällig am 01.07.2053 (l)	$ 33.900	$ (29.360)	(0,04)
2,500 % fällig am 01.08.2053	33.900	(29.382)	(0,05)
3,500 % fällig am 01.07.2053 (l)	12.900	(11.908)	(0,02)
Summe Leerverkaufte Wertpapiere		**$ (70.650)**	**(0,11)**
Summe Anlagen		**$ 84.767.863**	**131,37**
Sonstige Aktiva und Passiva		**$ (20.240.296)**	**(31,37)**
Nettovermögen		**$ 64.527.567**	**100,00**

ERLÄUTERUNGEN ZUR AUFSTELLUNG DES WERTPAPIERBESTANDS (Angaben in Tausend*):

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

µ Der gesamte Betrag oder ein Teil davon stellt ungedeckte Kreditengagements dar. Der Zinssatz für den ungedeckten Anteil wird zum Zeitpunkt der Finanzierung festgelegt.

^ Das Wertpapier ist in Verzug.

(a) Bei dem Wertpapier handelt es sich um ein Interest Only- („IO“) bzw. IO-Strip.

(b) Reines Kapitalwertpapier.

(c) Wertpapier per Emissionstermin.

(d) Wertpapier mit Sachwertausschüttung.

(e) Das Wertpapier hat in den letzten zwölf Monaten keine Erträge geliefert.

(f) Nullkuponwertpapier.

(g) Der Kupon stellt eine Rendite bis zur Endfälligkeit dar.

(h) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

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

(j) Mit dem Fonds verbunden.

(k) Bedingt wandelbares Wertpapier.

(l) Zum 30. Juni 2023 leerverkaufte Wertpapiere sind durch langfristige Portfolioanlagen in übertragbaren Wertpapieren und Geldmarktinstrumenten abgedeckt.

(m) Eingeschränkte Wertpapiere (31. Dezember 2022: 0,97 %):

Emittentenbeschreibung	Kauf-datum	Kosten	Markt-wert	% des Nettovermögens
Chester A PLC 0,000 % fällig am 17.03.2046	18.04.2019	$ 12.844	$ 15.221	0,02
Chester A PLC 0,000 % fällig am 20.05.2046	18.04.2019	17.298	5.711	0,01
Chester A PLC 5,702 % fällig am 17.03.2046	18.04.2019	67.109	65.956	0,10
Chester A PLC 6,152 % fällig am 17.03.2046	18.04.2019	19.159	18.645	0,03
Chester A PLC 6,652 % fällig am 17.03.2046	18.04.2019	17.790	17.191	0,03
Chester A PLC 7,152 % fällig am 17.03.2046	18.04.2019	10.947	10.491	0,02
Chester A PLC 7,902 % fällig am 17.03.2046	18.04.2019	5.473	5.163	0,01
Constellation Oil Services Holding S.A. 'B'	10.06.2022	353	353	0,00
Constellation Oil Services Holding S.A. 'D' - Exp. 10.06.2071	10.06.2022	0	0	0,00
Corestate Capital Holding S,A, 15,000 % fällig am 31.07.2023	06.12.2022	1.050	1.102	0,00
Deutsche Bank AG 2,129 % fällig am 24.11.2026	11.01.2023	21.934	21.631	0,03
Deutsche Bank AG 3,035 % fällig am 28.05.2032	25.05.2021 - 29.09.2021	46.076	36.192	0,06
Intelsat Emergence S.A.	19.06.2017 - 23.02.2022	440.150	106.931	0,16
Morgan Stanley 0,000 % fällig am 02.04.2032	11.02.2020	59.946	42.809	0,07
Neiman Marcus Group Ltd. LLC	25.09.2020	37.976	179.237	0,28
Oracle Corp, 3,950 % fällig am 25.03.2051	22.03.2021	16.942	12.841	0,02
Oracle Corp. 4,100 % fällig am 25.03.2061	22.03.2021 - 05.10.2021	26.506	18.545	0,03
Sierra Hamilton Holder LLC	31.07.2017	560	0	0,00
Westmoreland Mining Holdings LLC	08.12.2014 - 19.12.2019	1.691	374	0,00
		$ 786.506	$ 552.682	0,86

(n) Wertpapiere mit einem gesamten beizulegenden Zeitwert von 16.137 USD (31. Dezember 2022: 19.079 USD) wurden zum 30. Juni 2023 gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen als Sicherheit für Pensionsgeschäfte verpfändet.

Wertpapier mit einem gesamten beizulegenden Zeitwert von null USD (31. Dezember 2022: 1 USD) und Barmittel in Höhe von null USD (31. Dezember 2022: 273 USD) wurden zum 30. Juni 2023 gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte als Sicherheit erhalten.

Barmittel in Höhe von 1.729.845 USD (31. Dezember 2022: 1.599.431 USD) wurden zum 30. Juni 2023 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Barmittel in Höhe von 147.325 USD (31. Dezember 2022: 188.008 USD) wurden zum 30. Juni 2023 gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. als Sicherheit für Finanzderivate verpfändet.

Beizulegender Zeitwert[1]

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 30. Juni 2023 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie[2]	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	$ 247.863	$ 78.047.527	$ 723.095	$ 79.018.485
Investmentfonds	2.484.042	0	0	2.484.042
Pensionsgeschäfte	0	2.090.601	0	2.090.601
Finanzderivate[3]	4.935	1.241.892	(1.442)	1.245.385
Leerverkaufte Wertpapiere	0	(70.650)	0	(70.650)
Summen	**$ 2.736.840**	**$ 81.309.370**	**$ 721.653**	**$ 84.767.863**

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

Kategorie[2]	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	$ 330.063	$ 65.894.167	$ 1.022.241	$ 67.246.471
Investmentfonds	1.793.842	287.586	0	2.081.428
Pensionsgeschäfte	0	3.421.698	0	3.421.698
Finanzderivate[3]	35.705	1.477.546	3	1.513.254
Leerverkaufte Wertpapiere	0	(734.103)	0	(734.103)
Summen	**$ 2.159.610**	**$ 70.346.894**	**$ 1.022.244**	**$ 73.528.748**

[1] Weitere Informationen finden Sie in den Erläuterungen in Erläuterung 3.

[2] Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung des Wertpapierbestands.

[3] Finanzderivate können offene Terminkontrakte, Swap-, Verkaufs- oder Kaufoptionen sowie Devisenterminkontrakte enthalten.

Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2023:

Kontrahent	Kredit-zins	Abrechnungs-datum	Fälligkeits-datum	Kredit-betrag	Verbindlichkeiten aus umgekehrten Pensions-geschäften	% des Nettovermögens
BRC	2,000 %	10.05.2023	TBD[1]	€ (4.716)	$ (5.159)	(0,01)
MBC	4,650	30.06.2023	TBD[1]	$ (3.161)	(3.161)	0,00
Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte					**$ (8.320)**	**(0,01)**

[1] Umgekehrtes Pensionsgeschäft mit offener Laufzeit.

Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC-Derivate und -Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2023 und 31. Dezember 2022:

	Zum 30. Jun. 2023			Zum 31. Dez. 2022		
Kontrahent	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-engagement[1]	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-engagement[1]
AZD	$ 3.553	$ (2.760)	$ 793	$ 2.601	$ (920)	$ 1.681
BOA	87.921	(72.150)	15.771	(36.145)	30.410	(5.735)
BOM	k. A.	k. A.	k. A.	(1.847)	2.130	283
BPS	53.184	(37.570)	15.614	37.581	(31.520)	6.061
BRC	15.698	(13.344)	2.354	(19.965)	16.765	(3.200)
BSH	k. A.	k. A.	k. A.	(15)	0	(15)
BYL	(694)	0	(694)	(1.443)	0	(1.443)
CBK	111.321	(102.271)	9.050	63.317	(64.234)	(917)
CLY	k. A.	k. A.	k. A.	29	0	29
DUB	5.408	(4.210)	1.198	(21.446)	18.530	(2.916)
FAR	(1.361)	1.570	209	(2.129)	2.290	161
FBF	(5.366)	6.053	687	(4.557)	4.715	158
GLM	40.729	(21.620)	19.109	(618)	(8.230)	(8.848)
GST	(25.672)	28.106	2.434	(18.731)	8.496	(10.235)
HUS	1.679	(1.680)	(1)	1.179	(520)	659
IND	(2.605)	3.310	705	k. A.	k. A.	k. A.
JPM	29.658	(25.510)	4.148	9.738	(8.970)	768
JPS	(1.894)	2.090	196	(1.195)	1.120	(75)
MBC	44.257	(38.610)	5.647	112.677	(90.850)	21.827
MEI	(503)	576	73	(363)	294	(69)
MSC	(18)	0	(18)	k. A.	k. A.	k. A.
MYC	(16.280)	36.980	20.700	(9.537)	(29.220)	(38.757)
MYI	(64.245)	45.110	(19.135)	44.132	(35.730)	8.402
RBC	11.696	(11.670)	26	(1.592)	2.500	908
RYL	65	0	65	(10.431)	8.200	(2.231)
SAL	(21.448)	23.530	2.082	(15.988)	16.088	100
SCX	25.953	(20.680)	5.273	122.133	(112.350)	9.783
SOG	81.404	(59.920)	21.484	10	0	10
SSB	4.860	(5.020)	(160)	k. A.	k. A.	k. A.
TOR	8.320	(8.420)	(100)	1.135	(920)	215
UAG	5.043	0	5.043	(36.981)	30.720	(6.261)

[1] Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären.

Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung des Wertpapierbestands zum 30. Juni 2023:

	30. Jun. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	59,20	68,71
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	63,14	45,07
Sonstige übertragbare Wertpapiere	0,11	2,21
Investmentfonds	3,85	3,59
Pensionsgeschäfte	3,24	5,90
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	(0,01)	0,15
Zentral abgerechnete Finanzderivate	1,34	2,09
Freiverkehrsfinanzderivate	0,61	0,37
Leerverkaufte Wertpapiere	(0,11)	(1,27)
Umgekehrte Pensionsgeschäfte	(0,01)	(0,03)

Das Anlageportfolio des Fonds konzentriert sich zum 30. Juni 2023 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	30. Jun. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
Kreditbeteiligungen und -abtretung	2,54	3,66
Unternehmensanleihen und Wechsel	18,55	22,63
Wandelanleihen & Wechsel	0,03	0,03
Kommunalanleihen und Wechsel	0,13	0,15
US-Regierungsbehörden	51,65	35,26
US-Schatzobligationen	20,40	17,94
Non-Agency-MBS	11,83	12,73
Forderungsbesicherte Wertpapiere	7,67	8,72
Staatsemissionen	3,35	5,29
Stammaktien	0,65	0,93
Bezugsrechte	0,01	0,01
Optionsscheine	0,05	0,07
Vorzugswertpapiere	0,20	0,23
Real Estate Investment Trusts	0,29	0,34
Kurzfristige Instrumente	5,10	8,00
Investmentfonds	3,85	3,59
Pensionsgeschäfte	3,24	5,90
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	0,06	0,16
Verkaufsoptionen		
Optionen auf börsengehandelte Terminkontrakte	(0,07)	(0,01)

Anlagen zum Marktwert	30. Jun. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	0,03	0,00
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzkauf	0,00	0,00
Credit Default Swaps auf Kreditindizes— Schutzverkauf	0,32	0,41
Zinsswaps	0,99	1,68
Freiverkehrsfinanzderivate		
Optionskauf		
Zinsswapoptionen	0,20	0,21
Verkaufsoptionen		
Credit Default Swaptions auf Kreditindizes	k. A.	0,00
Zinsswapoptionen	(0,12)	(0,17)
Zinscaps	(0,11)	(0,10)
Optionen auf Wertpapiere	0,00	(0,01)
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen - Schutzkauf	0,00	0,00
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	(0,01)	(0,06)
Credit Default Swaps auf Kreditindizes— Schutzverkauf	(0,11)	(0,06)
Total Return Swaps auf Indizes	k. A.	0,00
Devisenterminkontrakte	0,24	(0,26)
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	0,52	0,82
Leerverkaufte Wertpapiere	(0,11)	(1,27)
Sonstige Aktiva und Passiva	(31,37)	(26,82)
Nettovermögen	100,00	100,00

BESCHREIBUNG		PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE				
KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG				
Air Canada				
8,839 % fällig am 11.08.2028	$	198	$ 199	0,20
CommScope, Inc.				
8,443 % fällig am 06.04.2026		198	190	0,19
Intelsat Jackson Holdings S.A.				
9,443 % fällig am 01.02.2029		17	17	0,02
Poseidon BidCo S.A.S				
8,848 % fällig am 14.07.2028	€	200	214	0,22
U.S. Renal Care, Inc.				
10,192 % fällig am 26.06.2026	$	247	116	0,12
United Airlines, Inc.				
9,292 % fällig am 21.04.2028		195	195	0,20
			931	0,95
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
BANKEN UND FINANZEN				
AGFC Capital Trust				
7,010 % fällig am 15.01.2067		440	237	0,24
Banca Monte dei Paschi di Siena SpA				
1,875 % fällig am 09.01.2026	€	200	194	0,20
6,750 % fällig am 02.03.2026		640	700	0,72
Bank of Ireland Group PLC				
6,000 % fällig am 01.09.2025 (c)(e)		200	207	0,21
BNP Paribas S.A.				
7,750 % fällig am 16.08.2029 (c)(e)	$	300	291	0,30
CaixaBank S.A.				
6,208 % fällig am 18.01.2029		350	350	0,36
Citizens Bank N.A.				
5,284 % fällig am 26.01.2026		300	279	0,29
Country Garden Holdings Co. Ltd.				
2,700 % fällig am 12.07.2026		200	61	0,06
Credit Suisse AG AT1 Claim ^		250	10	0,01
Deutsche Bank AG				
3,547 % fällig am 18.09.2031		200	166	0,17
3,742 % fällig am 07.01.2033		200	147	0,15
Ford Motor Credit Co. LLC				
2,386 % fällig am 17.02.2026	€	100	103	0,11
Intesa Sanpaolo SpA				
4,198 % fällig am 01.06.2032	$	500	373	0,38
5,875 % fällig am 01.09.2031 (c)(e)	€	350	305	0,31
KBC Group NV				
5,796 % fällig am 19.01.2029	$	600	596	0,61
Nationwide Building Society				
5,750 % fällig am 20.06.2027 (c)(e)	£	200	218	0,22
Navient Corp.				
5,000 % fällig am 15.03.2027	$	250	224	0,23
Santander UK Group Holdings PLC				
6,534 % fällig am 10.01.2029		300	302	0,31
Swiss Insured Brazil Power Finance SARL				
9,850 % fällig am 16.07.2032	BRL	1.001	191	0,20
UBS Group AG				
4,375 % fällig am 10.02.2031 (c)(e)	$	250	177	0,18
4,875 % fällig am 12.02.2027 (c)(e)		200	161	0,16
6,537 % fällig am 12.08.2033		250	256	0,26
UniCredit SpA				
4,450 % fällig am 03.12.2027 (c)(e)	€	400	344	0,35
5,459 % fällig am 30.06.2035	$	300	255	0,26
			6.147	6,29
INDUSTRIEWERTE				
American Airlines Pass-Through Trust				
3,375 % fällig am 01.11.2028		480	431	0,44
Amgen, Inc.				
5,150 % fällig am 02.03.2028		100	100	0,10
5,250 % fällig am 02.03.2033		100	100	0,10
Carvana Co.				
10,250 % fällig am 01.05.2030		100	79	0,08
Charter Communications Operating LLC				
3,500 % fällig am 01.06.2041		100	68	0,07
Clear Channel Outdoor Holdings, Inc.				
7,750 % fällig am 15.04.2028		240	189	0,19
CSC Holdings LLC				
4,500 % fällig am 15.11.2031	$	200	$ 140	0,14
Directv Financing LLC				
5,875 % fällig am 15.08.2027		350	317	0,32
DISH DBS Corp.				
5,250 % fällig am 01.12.2026		130	104	0,11
5,750 % fällig am 01.12.2028		130	97	0,10
Enbridge, Inc.				
5,700 % fällig am 08.03.2033		400	406	0,42
Glencore Funding LLC				
4,000 % fällig am 27.03.2027		300	286	0,29
Imperial Brands Finance PLC				
3,500 % fällig am 26.07.2026		300	280	0,29
Intelsat Jackson Holdings S.A.				
6,500 % fällig am 15.03.2030		70	64	0,07
MGM China Holdings Ltd.				
4,750 % fällig am 01.02.2027		200	182	0,19
Mundys SpA				
1,875 % fällig am 12.02.2028	€	300	280	0,29
NCL Corp. Ltd.				
5,875 % fällig am 15.02.2027	$	150	146	0,15
Petroleos Mexicanos				
6,500 % fällig am 02.06.2041		100	64	0,07
6,700 % fällig am 16.02.2032		279	212	0,22
Prosus NV				
3,257 % fällig am 19.01.2027		200	181	0,18
Studio City Co. Ltd.				
7,000 % fällig am 15.02.2027		200	187	0,19
Venture Global Calcasieu Pass LLC				
3,875 % fällig am 15.08.2029		200	175	0,18
			4.088	4,19
VERSORGUNGSUNTERNEHMEN				
Gazprom PJSC Via Gaz Finance PLC				
1,500 % fällig am 17.02.2027	€	250	178	0,18
Pacific Gas & Electric Co.				
3,000 % fällig am 15.06.2028	$	300	259	0,26
3,150 % fällig am 01.01.2026		300	279	0,29
4,450 % fällig am 15.04.2042 ^		250	190	0,19
5,250 % fällig am 01.03.2052		200	163	0,17
5,900 % fällig am 15.06.2032		300	289	0,30
6,700 % fällig am 01.04.2053		400	393	0,40
Petrobras Global Finance BV				
6,850 % fällig am 05.06.2115		45	39	0,04
7,250 % fällig am 17.03.2044		42	41	0,04
			1.831	1,87
Summe Unternehmensanleihen und Wechsel			12.066	12,35
US-REGIERUNGSBEHÖRDEN				
Ginnie Mae, TBA				
5,000 % fällig am 01.07.2053		200	196	0,20
Uniform Mortgage-Backed Security				
3,000 % fällig am 01.06.2052		2.742	2.416	2,47
3,500 % fällig am 01.05.2052 - 01.02.2053		4.919	4.486	4,59
4,000 % fällig am 01.09.2048 - 01.04.2053		7.837	7.361	7,54
4,500 % fällig am 01.10.2052 - 01.03.2053		4.633	4.458	4,56
5,000 % fällig am 01.01.2053		2.434	2.386	2,44
5,500 % fällig am 01.03.2053		3.847	3.830	3,92
6,000 % fällig am 01.04.2053		1.773	1.789	1,83
Uniform Mortgage-Backed Security, TBA				
4,500 % fällig am 01.07.2053		400	385	0,40
5,500 % fällig am 01.08.2053		1.700	1.692	1,73
6,000 % fällig am 01.07.2053		100	101	0,11
6,500 % fällig am 01.07.2053		6.100	6.225	6,37
			35.325	36,16
US-SCHATZOBLIGATIONEN				
U.S. Treasury Inflation Protected Securities (b)				
0,125 % fällig am 15.07.2024		1.929	1.871	1,91
0,125 % fällig am 15.10.2024		1.478	1.426	1,46
0,125 % fällig am 15.02.2052		654	434	0,44
0,250 % fällig am 15.01.2025		1.281	1.228	1,26
0,250 % fällig am 15.07.2029		474	433	0,44
0,375 % fällig am 15.07.2023	$	547	$ 547	0,56
0,500 % fällig am 15.04.2024		589	575	0,59
0,625 % fällig am 15.01.2024		962	946	0,97
0,625 % fällig am 15.07.2032		2.714	2.496	2,55
1,000 % fällig am 15.02.2049		121	104	0,11
1,625 % fällig am 15.10.2027		307	303	0,31
U.S. Treasury Notes				
2,375 % fällig am 31.03.2029		500	457	0,47
3,125 % fällig am 15.08.2025		7.500	7.245	7,41
3,500 % fällig am 31.01.2028		1.100	1.068	1,09
3,875 % fällig am 31.12.2027		1.600	1.578	1,62
4,125 % fällig am 15.11.2032		1.200	1.226	1,26
			21.937	22,45
NON-AGENCY-MBS				
1211 Avenue of the Americas Trust				
4,280 % fällig am 10.08.2035		400	349	0,36
225 Liberty Street Trust				
4,501 % fällig am 10.02.2036		500	416	0,43
280 Park Avenue Mortgage Trust				
6,718 % fällig am 15.09.2034		100	89	0,09
Adjustable Rate Mortgage Trust				
5,390 % fällig am 25.08.2036		674	248	0,25
Alba PLC				
5,261 % fällig am 15.12.2038	£	614	723	0,74
Bridgegate Funding PLC				
8,466 % fällig am 16.10.2062		190	239	0,24
9,466 % fällig am 16.10.2062		190	238	0,24
Eurosail PLC				
3,909 % fällig am 13.03.2045	€	500	490	0,50
3,919 % fällig am 13.03.2045		1.500	1.411	1,44
Great Hall Mortgages PLC				
5,282 % fällig am 18.06.2038	£	2.960	3.648	3,73
GS Mortgage Securities Corp. Trust				
7,193 % fällig am 15.11.2032	$	489	481	0,49
Harbour				
6,557 % fällig am 28.01.2054	£	2.000	2.434	2,49
Hospitality Mortgage Trust				
7,193 % fällig am 15.11.2036	$	178	172	0,18
JPMorgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust				
2,949 % fällig am 06.09.2038		900	791	0,81
Jupiter Mortgage PLC				
8,241 % fällig am 20.07.2060	£	900	1.125	1,15
Lehman XS Trust				
5,510 % fällig am 25.11.2035	$	432	386	0,40
Mansard Mortgages PLC				
4,935 % fällig am 15.10.2048	£	455	553	0,57
Morgan Stanley Capital Trust				
6,393 % fällig am 15.07.2035	$	450	444	0,45
Newgate Funding PLC				
5,038 % fällig am 01.12.2050	£	365	439	0,45
Residential Accredit Loans, Inc. Trust				
6,000 % fällig am 25.09.2035 ^	$	117	102	0,10
6,000 % fällig am 25.09.2035		118	103	0,11
Stratton Mortgage Funding PLC				
7,491 % fällig am 20.07.2060	£	440	553	0,57
Trinity Square PLC				
7,216 % fällig am 15.07.2059		500	624	0,64
WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust				
4,081 % fällig am 25.07.2037 ^	$	529	494	0,51
			16.552	16,94
FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE				
Argent Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates				
6,950 % fällig am 25.11.2034		400	363	0,37
Countrywide Asset-Backed Certificates Trust				
5,370 % fällig am 25.08.2037		270	235	0,24
5,370 % fällig am 25.06.2047 ^		247	223	0,23
First Franklin Mortgage Loan Trust				
4,234 % fällig am 25.03.2036		732	650	0,67
Home Equity Asset Trust				
5,810 % fällig am 25.04.2036		738	645	0,66
Long Beach Mortgage Loan Trust				
5,380 % fällig am 25.12.2036		632	231	0,24
5,470 % fällig am 25.10.2036		764	238	0,24
5,750 % fällig am 25.02.2036		363	299	0,31

BESCHREIBUNG		PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
Morgan Stanley Capital, Inc. Trust				
5,705 % fällig am 25.01.2036	$	900	$ 695	0,71
New Century Home Equity Loan Trust				
5,885 % fällig am 25.10.2035		700	571	0,58
Structured Asset Investment Loan Trust				
6,125 % fällig am 25.05.2035		711	610	0,62
Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust				
5,440 % fällig am 25.07.2036 ^		667	634	0,65
			5.394	5,52
STAATSEMISSIONEN				
Argentina Government International Bond				
0,500 % fällig am 09.07.2030		160	53	0,06
1,500 % fällig am 09.07.2035		179	54	0,06
3,500 % fällig am 09.07.2041		272	88	0,09
3,875 % fällig am 09.01.2038		63	22	0,02

BESCHREIBUNG		PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
Bonos de la Tesoreria de la Republica en Pesos				
4,500 % fällig am 01.03.2026	CLP	50.000	$ 61	0,06
Mexico Government International Bond				
5,750 % fällig am 12.10.2110	$	100	89	0,09
6,350 % fällig am 09.02.2035		200	211	0,22
10,000 % fällig am 05.12.2024	MXN	10.000	579	0,59
Romania Government International Bond				
3,750 % fällig am 07.02.2034	€	220	195	0,20
Russia Government International Bond				
5,250 % fällig am 23.06.2047 ^	$	200	12	0,01
South Africa Government International Bond				
10,500 % fällig am 21.12.2026	ZAR	5.560	306	0,31
Turkey Government International Bond				
5,250 % fällig am 13.03.2030	$	1.000	823	0,84
5,750 % fällig am 11.05.2047		250	171	0,18
			2.664	2,73

BESCHREIBUNG	AKTIEN	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
STAMMAKTIEN			
KOMMUNIKATIONSDIENSTE			
Intelsat Emergence S.A. (a)(f)	935	$ 21	0,02
RECHTE			
Intelsat Jackson Holdings S.A. - Exp. 05.12.2025	194	1	0,00
Summe Übertragbare Wertpapiere		**94.891**	**97,12**
INVESTMENTFONDS			
ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN			
PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (d)	763.914	7.607	7,78
Summe Investmentfonds		**$ 7.607**	**7,78**

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

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

FUTURES

Beschreibung	Art	Ablauf-monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Euro-Bund 10-Year Bond September Futures	Long	09.2023	1	$ (1)	0,00
U.S. Treasury 10-Year Note September Futures	Long	09.2023	24	(22)	(0,02)
				$ (23)	(0,02)

VERKAUFSOPTIONEN

OPTIONEN AUF BÖRSENGEHANDELTE TERMINKONTRAKTE

Beschreibung	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Anzahl der Kontrakte	Aufgeld	Markt-wert	% des Nettovermögens
Call - CME-Kaufoptionen mit Ausübungskurs bei 98,000 USD auf 3-Month SOFR December Futures	$ 98,000	15.12.2023	1	$ (1)	$ 0	0,00
Put - CME-Verkaufsoptionen mit Ausübungskurs bei 96,500 USD auf 3-Month SOFR December Futures	96,500	15.12.2023	1	(1)	(5)	(0,01)
				$ (2)	$ (5)	(0,01)
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate					**$ (28)**	**(0,03)**

ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)

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

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES - SCHUTZVERKAUF[1]

Index/Tranchen	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag[2]	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
CDX.EM-36 5-Year Index	1,000 %	20.12.2026	$ 644	$ 20	0,02
CDX.EM-38 5-Year Index	1,000	20.12.2027	1.500	23	0,02
CDX.EM-39 5-Year Index	1,000	20.06.2028	700	14	0,01
CDX.HY-40 5-Year Index	5,000	20.06.2028	6.400	153	0,16
				$ 210	0,21

ZINSSWAPS

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,000 %	16.06.2028	¥ 130.000	$ 8	0,01
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,000	15.12.2028	490.000	(63)	(0,06)
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,200	15.12.2041	30.000	(1)	0,00
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,400	15.06.2032	40.000	3	0,00
Erhalt[3]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,250	16.06.2051	$ 450	117	0,12
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,750	21.12.2052	800	(23)	(0,03)
Erhalt[3]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,350	17.01.2025	900	21	0,02
Erhalt[3]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,450	20.12.2024	3.800	62	0,06
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,750	21.06.2053	1.750	(13)	(0,01)
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,000	21.06.2033	9.850	336	0,34
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,250	21.06.2028	24.900	(729)	(0,75)
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,610	12.12.2032	100	1	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,250	16.09.2023	450	5	0,01
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,100	11.04.2024	€ 100	(2)	0,00

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,100 %	13.04.2024	€ 200	$ (3)	0,00
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,100	17.05.2024	100	(2)	0,00
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,250	28.04.2024	100	(2)	0,00
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,250	03.05.2024	100	(2)	0,00
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,547	09.03.2033	100	(2)	0,00
Erhalt[3]	6-Month EUR-EURIBOR	3,000	20.09.2028	400	(1)	0,00
Erhalt[3]	6-Month EUR-EURIBOR	3,000	20.09.2033	1.100	(8)	(0,01)
					$ (298)	(0,30)
Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate					**$ (88)**	**(0,09)**

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

(2) Der maximal mögliche Betrag, den der Fonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

(3) Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft.

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

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

VERKAUFSOPTIONEN

ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag[1]	Aufgeld	Markt-wert	% des Nettovermögens
BOA	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,150 %	01.12.2023	100	$ 1	$ 0	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,650	01.12.2023	100	1	(2)	0,00
BPS	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,200	06.07.2023	100	0	0	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,650	06.07.2023	100	0	0	0,00
DUB	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,920	13.10.2023	100	(1)	0	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,920	13.10.2023	100	(1)	(2)	(0,01)
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,790	08.04.2024	100	(1)	0	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,790	08.04.2024	100	(1)	(2)	0,00
GLM	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,920	13.10.2023	100	(1)	0	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,920	13.10.2023	100	(1)	(2)	(0,01)
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,018	20.10.2023	100	(1)	0	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,018	20.10.2023	100	(1)	(2)	0,00
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,140	23.10.2023	100	(1)	0	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,140	23.10.2023	100	(1)	(2)	0,00
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,190	23.10.2023	100	(1)	0	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,190	23.10.2023	100	(1)	(2)	0,00
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,225	23.10.2023	100	(1)	0	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,225	23.10.2023	100	(1)	(2)	0,00
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,973	25.10.2023	100	(1)	0	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,973	25.10.2023	100	(1)	(2)	0,00
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,841	27.10.2023	100	(1)	0	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,841	27.10.2023	100	(1)	(2)	(0,01)
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,088	03.11.2023	100	(1)	0	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,088	03.11.2023	100	(1)	(2)	0,00
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,910	10.11.2023	100	(1)	0	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,910	10.11.2023	100	(1)	(2)	0,00
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,250	17.11.2023	100	0	0	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,750	17.11.2023	100	0	(1)	0,00
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,150	20.11.2023	100	0	0	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,650	20.11.2023	100	0	(2)	0,00
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,250	07.12.2023	100	1	0	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,750	07.12.2023	100	1	(1)	0,00
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,697	02.04.2024	100	(1)	0	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,697	02.04.2024	100	(1)	(2)	0,00
MYC	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,300	10.07.2023	100	0	0	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,750	10.07.2023	100	0	0	0,00
							$ (20)	$ (30)	(0,03)

(1) Der Nennbetrag stellt die Anzahl der Kontrakte dar.

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMMISSIONEN - SCHUTZVERKAUF[1]

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag[2]	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Markt-wert	% des Nettovermögens
MYC	South Africa Government International Bond	1,000 %	20.12.2026	$ 200	$ (9)	$ 2	$ (7)	(0,01)

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

(2) Der maximal mögliche Betrag, den der Fonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung		Zu erhaltende Währung		Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
AZD	07.2023	AUD	136	$	89	$ 0	$ (2)	$ (2)	0,00
BOA	07.2023	MXN	19.278		1.100	0	(22)	(22)	(0,02)
	08.2023	$	1.997	AUD	2.958	0	(26)	(26)	(0,03)
	08.2023		38	CNY	264	0	(2)	(2)	0,00
	08.2023		315	NZD	497	0	(11)	(11)	(0,01)
	09.2023	TWD	2.442	$	80	2	0	2	0,00
	09.2023	$	126	HKD	988	0	0	0	0,00
	09.2023		161	KRW	204.490	0	(6)	(6)	(0,01)
BPS	07.2023	HKD	107	$	14	0	0	0	0,00
	07.2023	$	140	AUD	212	1	0	1	0,00
	08.2023	AUD	212	$	141	0	(1)	(1)	0,00
	08.2023	CNH	274		40	2	0	2	0,00
	08.2023	TWD	1.222		40	1	0	1	0,00
	08.2023	$	20	CNY	139	0	(1)	(1)	0,00
	08.2023		352	MXN	6.135	2	0	2	0,00
	09.2023		16	IDR	246.803	0	0	0	0,00
	10.2023	ZAR	5.836	$	314	8	0	8	0,01
	12.2023	MXN	1.256		70	0	(1)	(1)	0,00
BRC	08.2023	€	4.259		4.652	0	(4)	(4)	0,00
	08.2023	£	8.440		10.561	0	(171)	(171)	(0,17)
	09.2023	HKD	1.110		142	0	0	0	0,00
	09.2023	IDR	1.279		0	0	0	0	0,00
CBK	07.2023	BRL	964		195	0	(5)	(5)	0,00
	07.2023	$	75	BRL	365	1	0	1	0,00
	07.2023		328	CLP	265.479	2	0	2	0,00
	07.2023		1.016	MXN	19.561	122	0	122	0,13
	08.2023	£	196	$	244	0	(6)	(6)	(0,01)
	08.2023	TWD	1.176		39	1	0	1	0,00
	08.2023	$	51	BRL	265	3	0	3	0,00
	08.2023		573	¥	76.124	0	(43)	(43)	(0,04)
	09.2023	KRW	2.005	$	2	0	0	0	0,00
	09.2023	$	1	IDR	9.188	0	0	0	0,00
DUB	07.2023		1.192	BRL	6.457	147	0	147	0,15
GLM	07.2023	BRL	6.398	$	1.315	0	(11)	(11)	(0,01)
	07.2023	$	97	BRL	521	11	0	11	0,01
	09.2023	TWD	4.269	$	140	3	0	3	0,00
	09.2023	$	1.226	BRL	5.984	1	0	1	0,00
	10.2023		135	MXN	2.363	1	0	1	0,00
MBC	08.2023	CNH	188	$	27	1	0	1	0,00
	09.2023	$	297	KRW	379.065	0	(8)	(8)	(0,01)
MYI	07.2023	AUD	197	$	131	0	0	0	0,00
	07.2023	€	480		523	0	0	0	0,00
	07.2023	£	33		42	0	0	0	0,00
	07.2023	IDR	82.509		5	0	0	0	0,00
	07.2023	$	6	IDR	82.509	0	0	0	0,00
	08.2023	€	63	$	68	0	(1)	(1)	0,00
	08.2023	TWD	1.326		44	1	0	1	0,00
	08.2023	$	1.058	¥	140.541	0	(79)	(79)	(0,08)
	09.2023	IDR	82.581	$	6	0	0	0	0,00
	09.2023	KRW	1.000.285		766	4	0	4	0,00
	09.2023	$	26	IDR	393.464	0	0	0	0,00
	09.2023		333	KRW	426.008	0	(8)	(8)	(0,01)
SCX	08.2023	AUD	386	$	256	1	(2)	(1)	0,00
	08.2023	CNH	322		47	2	0	2	0,00
	08.2023	¥	22.300		162	7	0	7	0,01
	08.2023	NZD	687		418	0	(3)	(3)	0,00
	08.2023	$	57	CNY	389	0	(3)	(3)	0,00
	08.2023		110	NZD	176	0	(2)	(2)	0,00
	09.2023	TWD	2.040	$	67	1	0	1	0,00
	09.2023	$	661	IDR	9.830.878	0	(8)	(8)	(0,01)
SSB	07.2023	CLP	265.860	$	331	0	0	0	0,00
	08.2023	$	331	CLP	266.628	0	0	0	0,00
	09.2023		753	BRL	3.820	30	0	30	0,03
UAG	07.2023	AUD	109	$	71	0	(1)	(1)	0,00
	07.2023	$	22	AUD	34	0	0	0	0,00
	08.2023	AUD	34	$	22	0	0	0	0,00
	08.2023	ZAR	512		27	0	0	0	0,00
						$ 355	$ (427)	$ (72)	(0,07)

ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklasse Class E AUD (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung		Zu erhaltende Währung		Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
AZD	07.2023	AUD	538	$	357	$ 0	$ (1)	$ (1)	0,00
	07.2023	$	668	AUD	1.021	11	0	11	0,01
	08.2023		357		538	1	0	1	0,00
BOA	07.2023		2.217		3.402	51	(3)	48	0,05
BPS	07.2023	AUD	3.019	$	1.999	0	(12)	(12)	(0,01)
	07.2023	$	1.781	AUD	2.745	46	0	46	0,05
	08.2023		1.855		2.798	9	0	9	0,01
CBK	07.2023		426		653	9	0	9	0,01
SCX	07.2023	AUD	949	$	630	0	(2)	(2)	0,00
	07.2023	$	515	AUD	788	10	0	10	0,01
	08.2023		631		949	2	0	2	0,00
UAG	07.2023	AUD	3.222	$	2.139	4	(9)	(5)	(0,01)
	07.2023	$	795	AUD	1.214	13	0	13	0,01
	08.2023		2.141		3.222	9	(4)	5	0,01
						$ 165	$ (31)	$ 134	0,14

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklasse Class E EUR (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung		Zu erhaltende Währung		Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
AZD	07.2023	$	520	€	476	$ 0	$ 0	$ 0	0,00
BOA	07.2023	€	5	$	5	0	0	0	0,00
	07.2023	$	1.389	€	1.292	21	0	21	0,02
BPS	07.2023	€	1.502	$	1.646	7	0	7	0,01
	07.2023	$	1.387	€	1.290	21	0	21	0,02
	08.2023		1.615		1.472	0	(7)	(7)	(0,01)
BRC	07.2023		323		300	4	0	4	0,00
CBK	07.2023	€	1.695	$	1.842	0	(7)	(7)	(0,01)
	07.2023	$	217	€	200	1	0	1	0,00
	08.2023		1.781		1.636	6	0	6	0,01
MBC	07.2023		100		93	2	0	2	0,00
SCX	07.2023		1.408		1.316	27	0	27	0,03
						$ 89	$ (14)	$ 75	0,07

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklasse Class E GBP (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung		Zu erhaltende Währung		Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2023	£	354	$	445	$ 0	$ (5)	$ (5)	(0,01)
	07.2023	$	3.039	£	2.400	12	0	12	0,01
BPS	07.2023		3.352		2.710	94	0	94	0,10
BRC	07.2023		197		158	4	0	4	0,01
CBK	07.2023	£	62	$	79	0	0	0	0,00
	07.2023	$	242	£	192	2	0	2	0,00
MBC	07.2023		3.338		2.697	90	0	90	0,09
MYI	07.2023		3.360		2.703	77	0	77	0,08
						$ 279	$ (5)	$ 274	0,28
Summe Freiverkehrsfinanzderivate								**$ 374**	**0,38**

LEERVERKAUFTE WERTPAPIERE

BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
US-REGIERUNGSBEHÖRDEN			
Uniform Mortgage-Backed Security, TBA			
3,500 % fällig am 01.08.2053	$ 200	$ (182)	(0,19)
5,000 % fällig am 01.08.2053	200	(196)	(0,20)
Summe Leerverkaufte Wertpapiere		**$ (378)**	**(0,39)**
Summe Anlagen		**$ 102.378**	**104,77**
Sonstige Aktiva und Passiva		**$ (4.661)**	**(4,77)**
Nettovermögen		**$ 97.717**	**100,00**

ERLÄUTERUNGEN ZUR AUFSTELLUNG DES WERTPAPIERBESTANDS (Angaben in Tausend*):

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

^ **Das Wertpapier ist in Verzug.**

(a) **Das Wertpapier hat in den letzten zwölf Monaten keine Erträge geliefert.**

(b) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

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

(d) Mit dem Fonds verbunden.

(e) Bedingt wandelbares Wertpapier.

(f) Eingeschränkte Wertpapiere (31. Dezember 2022: 0,04 %):

Emittentenbeschreibung	Kauf-datum	Kosten	Markt-wert	% des Nettovermögens
Intelsat Emergence S.A.	24.02.2021	$ 77	$ 21	0,02

Barmittel in Höhe von 1.541 USD (31. Dezember 2022: 961 USD) wurden zum 30. Juni 2023 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Barmittel in Höhe von 141 USD (31. Dezember 2022: 61 USD) wurden zum 30. Juni 2023 gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. als Sicherheit für Finanzderivate verpfändet.

Beizulegender Zeitwert[1]

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 30. Juni 2023 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie[2]	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	$ 0	$ 94.643	$ 248	$ 94.891
Investmentfonds	7.607	0	0	7.607
Finanzderivate[3]	(1)	259	0	258
Leerverkaufte Wertpapiere	0	(378)	0	(378)
Summen	**$ 7.606**	**$ 94.524**	**$ 248**	**$ 102.378**

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

Kategorie[2]	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	$ 0	$ 56.688	$ 282	$ 56.970
Investmentfonds	1.740	0	0	1.740
Finanzderivate[3]	(4)	316	0	312
Summen	**$ 1.736**	**$ 57.004**	**$ 282**	**$ 59.022**

(1) Weitere Informationen finden Sie in den Erläuterungen in Erläuterung 3.

(2) Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung des Wertpapierbestands.

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

Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC-Finanzderivate und -Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2023 und 31. Dezember 2022:

	Zum 30. Jun. 2023			Zum 31. Dez. 2022		
Kontrahent	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-engagement[1]	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-engagement[1]
AZD	$ 9	$ 0	$ 9	$ 3	$ 0	$ 3
BOA	9	0	9	(65)	0	(65)
BPS	169	(260)	(91)	(73)	0	(73)
BRC	(167)	90	(77)	(5)	0	(5)
CBK	86	0	86	24	0	24
DUB	143	0	143	(2)	0	(2)
GLM	(19)	20	1	(36)	30	(6)
MBC	85	0	85	22	0	22
MYC	(7)	31	24	(8)	31	23
MYI	(6)	0	(6)	(10)	0	(10)
SCX	30	0	30	27	0	27
SSB	30	0	30	k. A.	k. A.	k. A.
UAG	12	0	12	3	0	3

(1) Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären.

Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung des Wertpapierbestands zum 30. Juni 2023:

	30. Jun. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	49,90	55,36
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	47,21	45,23
Sonstige übertragbare Wertpapiere	0,01	0,03
Investmentfonds	7,78	3,07
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	(0,03)	0,00

	30. Jun. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
Zentral abgerechnete Finanzderivate	(0,09)	0,76
Freiverkehrsfinanzderivate	0,38	(0,21)
Leerverkaufte Wertpapiere	(0,39)	k. A.

Das Anlageportfolio des Fonds konzentriert sich zum 30. Juni 2023 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	30. Jun. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
Kreditbeteiligungen und -abtretung	0,95	1,71
Unternehmensanleihen und Wechsel	12,35	12,97
US-Regierungsbehörden	36,16	19,84
US-Schatzobligationen	22,45	35,05
Non-Agency-MBS	16,94	17,43
Forderungsbesicherte Wertpapiere	5,52	10,35
Staatsemissionen	2,73	3,23
Stammaktien	0,02	0,04
Bezugsrechte	0,00	0,00
Investmentfonds	7,78	3,07
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	(0,02)	0,01
Verkaufsoptionen		
Optionen auf börsengehandelte Terminkontrakte	(0,01)	(0,01)
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Kreditindizes— Schutzverkauf	0,21	0,28
Zinsswaps	(0,30)	0,48
Freiverkehrsfinanzderivate		
Verkaufsoptionen		
Zinsswapoptionen	(0,03)	(0,08)
Optionen auf Wertpapiere	k. A.	0,00
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	(0,01)	(0,01)
Devisenterminkontrakte	(0,07)	(0,27)
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	0,49	0,15
Leerverkaufte Wertpapiere	(0,39)	k. A.
Sonstige Aktiva und Passiva	(4,77)	(4,24)
Nettovermögen	100,00	100,00

Aufstellung des Wertpapierbestands des Inflation Multi-Asset Fund

BESCHREIBUNG		PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
BANKEN UND FINANZEN				
Bank of America Corp.				
5,875 % fällig am 15.03.2028 (c)	$	60	$ 55	0,02
Jyske Realkredit A/S				
1,000 % fällig am 01.10.2050	DKK	6.512	687	0,21
1,500 % fällig am 01.10.2053		4.978	533	0,16
2,500 % fällig am 01.10.2047		1	0	0,00
Nordea Kredit Realkreditaktieselskab				
1,000 % fällig am 01.10.2050		0	0	0,00
1,000 % fällig am 01.10.2053		14	1	0,00
1,500 % fällig am 01.10.2053		13.395	1.406	0,43
2,000 % fällig am 01.10.2053		200	23	0,01
2,500 % fällig am 01.10.2047		0	0	0,00
Nykredit Realkredit A/S				
1,000 % fällig am 01.10.2050		8.352	879	0,27
1,000 % fällig am 01.10.2053		298	29	0,01
1,500 % fällig am 01.10.2053		25.770	2.743	0,85
2,000 % fällig am 01.10.2053		495	57	0,02
2,500 % fällig am 01.10.2047		3	0	0,00
3,500 % fällig am 01.10.2053		2.372	318	0,10
Realkredit Danmark A/S				
1,000 % fällig am 01.10.2050		3.161	333	0,10
1,000 % fällig am 01.10.2053		580	59	0,02
1,500 % fällig am 01.10.2050		1.305	140	0,04
1,500 % fällig am 01.10.2053		11.102	1.175	0,36
2,500 % fällig am 01.04.2047		2	0	0,00
			8.438	2,60
VERSORGUNGSUNTERNEHMEN				
Petrobras Global Finance BV				
7,250 % fällig am 17.03.2044	$	157	155	0,05
Summe Unternehmensanleihen und Wechsel			8.593	2,65
US-REGIERUNGSBEHÖRDEN				
Freddie Mac				
5,593 % fällig am 15.06.2047		681	657	0,20
Ginnie Mae				
3,858 % fällig am 20.08.2068		94	92	0,03
5,866 % fällig am 20.08.2072		2.039	2.033	0,63
5,966 % fällig am 20.10.2072 - 20.01.2073		8.786	8.724	2,69
6,166 % fällig am 20.05.2073		300	300	0,09
6,226 % fällig am 20.11.2072		1.889	1.908	0,59
Uniform Mortgage-Backed Security, TBA				
4,000 % fällig am 01.08.2053		14.900	13.996	4,32
4,500 % fällig am 01.08.2053		15.600	15.006	4,63
5,000 % fällig am 01.09.2053		5.800	5.687	1,75
5,500 % fällig am 01.08.2053		3.900	3.881	1,20
6,500 % fällig am 01.08.2053		4.600	4.694	1,45
			56.978	17,58
US-SCHATZOBLIGATIONEN				
U.S. Treasury Inflation Protected Securities (b)				
0,125 % fällig am 15.04.2025		2.114	2.011	0,62
0,125 % fällig am 15.04.2026		2.776	2.603	0,80
0,125 % fällig am 15.07.2026		190	178	0,05
0,125 % fällig am 15.10.2026		13.653	12.767	3,94
0,125 % fällig am 15.04.2027		752	696	0,21
0,125 % fällig am 15.01.2030		118	106	0,03
0,125 % fällig am 15.07.2030		473	425	0,13
0,125 % fällig am 15.07.2031		12.562	11.145	3,44
0,125 % fällig am 15.01.2032		9.519	8.385	2,59
0,125 % fällig am 15.02.2051		1.049	701	0,22
0,125 % fällig am 15.02.2052		654	434	0,13
0,250 % fällig am 15.02.2050		118	83	0,03
0,375 % fällig am 15.01.2027		1.871	1.756	0,54
0,375 % fällig am 15.07.2027		10.887	10.208	3,15
0,500 % fällig am 15.04.2024		1.323	1.291	0,40
0,500 % fällig am 15.01.2028		2.828	2.646	0,82
0,625 % fällig am 15.01.2024		588	578	0,18
0,625 % fällig am 15.01.2026		128	122	0,04
0,625 % fällig am 15.07.2032		6.159	5.664	1,75
0,625 % fällig am 15.02.2043		13	11	0,00
0,750 % fällig am 15.07.2028		2.187	2.073	0,64
0,750 % fällig am 15.02.2042		671	571	0,18
0,750 % fällig am 15.02.2045		1.417	1.172	0,36
0,875 % fällig am 15.01.2029	$	2.595	$ 2.457	0,76
0,875 % fällig am 15.02.2047		3.646	3.063	0,94
1,000 % fällig am 15.02.2046		3.034	2.635	0,81
1,000 % fällig am 15.02.2048		430	371	0,11
1,375 % fällig am 15.02.2044		2.082	1.963	0,61
1,500 % fällig am 15.02.2053		2.653	2.578	0,79
1,625 % fällig am 15.10.2027		11.877	11.706	3,61
2,000 % fällig am 15.01.2026		32	32	0,01
2,125 % fällig am 15.02.2040		70	75	0,02
2,125 % fällig am 15.02.2041		831	892	0,28
			91.398	28,19
NON-AGENCY-MBS				
1211 Avenue of the Americas Trust				
3,901 % fällig am 10.08.2035		1.900	1.770	0,55
Banc of America Alternative Loan Trust				
6,000 % fällig am 25.06.2046		183	161	0,05
Banc of America Funding Trust				
3,826 % fällig am 20.01.2047		199	170	0,05
6,000 % fällig am 25.03.2034		64	62	0,02
Bear Stearns Mortgage Funding Trust				
5,340 % fällig am 25.01.2037		2.803	2.546	0,79
CityLine Commercial Mortgage Trust				
2,871 % fällig am 10.11.2031		2.475	2.309	0,71
Countrywide Alternative Loan Trust				
6,000 % fällig am 25.04.2037		98	83	0,03
HarborView Mortgage Loan Trust				
6,057 % fällig am 20.06.2035		50	45	0,01
JPMorgan Mortgage Trust				
4,195 % fällig am 25.06.2035		0	0	0,00
New Residential Mortgage Loan Trust				
4,500 % fällig am 25.05.2058		143	136	0,04
One Market Plaza Trust				
3,614 % fällig am 10.02.2032		2.000	1.852	0,57
Polaris PLC				
5,640 % fällig am 23.10.2059	£	374	472	0,15
Sequoia Mortgage Trust				
5,557 % fällig am 20.07.2036	$	150	129	0,04
Towd Point Mortgage Trust				
3,500 % fällig am 25.01.2058		2.230	2.044	0,63
WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust				
4,163 % fällig am 25.09.2033		1	1	0,00
5,810 % fällig am 25.01.2045		185	172	0,05
6,170 % fällig am 25.08.2045		1.717	1.631	0,50
			13.583	4,19
FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE				
Ameriquest Mortgage Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates				
5,930 % fällig am 25.05.2034		52	52	0,02
Asset-Backed Funding Certificates Trust				
5,750 % fällig am 25.10.2034		34	34	0,01
Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust				
5,368 % fällig am 25.02.2036		118	118	0,04
CIT Mortgage Loan Trust				
6,500 % fällig am 25.10.2037		16	16	0,01
Citigroup Mortgage Loan Trust				
5,440 % fällig am 25.09.2036		97	92	0,03
Citigroup Mortgage Loan Trust Asset-Backed Pass-Through Certificates				
6,095 % fällig am 25.10.2034		145	137	0,04
Countrywide Asset-Backed Certificates Trust				
5,330 % fällig am 25.06.2047		2.048	1.913	0,59
Encore Credit Receivables Trust				
6,050 % fällig am 25.01.2036		900	847	0,26
First Franklin Mortgage Loan Trust				
5,460 % fällig am 25.07.2036		150	141	0,04
5,930 % fällig am 25.09.2035		80	80	0,02
6,020 % fällig am 25.09.2035		176	173	0,05
Home Equity Asset Trust				
6,005 % fällig am 25.08.2034		131	128	0,04
HSI Asset Securitization Corp. Trust				
5,470 % fällig am 25.05.2037		19	19	0,01
JPMorgan Mortgage Acquisition Trust				
5,470 % fällig am 25.07.2036		1.675	1.638	0,51
Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust				
5,810 % fällig am 25.01.2035	$	110	$ 107	0,03
Park Place Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates				
6,950 % fällig am 25.12.2034		712	689	0,21
Popular ABS Mortgage Pass-Through Trust				
5,460 % fällig am 25.06.2047 ^		1.883	1.741	0,54
Residential Asset Securities Corp. Trust				
5,430 % fällig am 25.09.2036		848	824	0,25
5,645 % fällig am 25.04.2036		36	35	0,01
Securitized Asset-Backed Receivables LLC Trust				
5,410 % fällig am 25.12.2036		1.806	1.623	0,50
Wells Fargo Home Equity Asset-Backed Securities Trust				
6,875 % fällig am 25.11.2035		1.000	985	0,30
			11.392	3,51
STAATSEMISSIONEN				
Australia Government International Bond				
0,250 % fällig am 21.11.2032	AUD	2.804	1.636	0,50
0,750 % fällig am 21.11.2027		718	464	0,14
3,000 % fällig am 20.09.2025		1.213	832	0,26
Canadian Government Real Return Bond				
0,500 % fällig am 01.12.2050 (b)	CAD	241	146	0,05
1,250 % fällig am 01.12.2047 (b)		2.219	1.608	0,50
Denmark Government International Bond				
0,100 % fällig am 15.11.2023 (b)	DKK	3.548	521	0,16
France Government International Bond				
0,100 % fällig am 01.03.2028 (b)	€	932	999	0,31
0,100 % fällig am 25.07.2031 (b)		1.988	2.109	0,65
0,100 % fällig am 25.07.2038 (b)		976	992	0,31
0,700 % fällig am 25.07.2030 (b)		1.597	1.776	0,55
1,800 % fällig am 25.07.2040 (b)		42	55	0,02
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro				
0,100 % fällig am 15.05.2033 (b)		6.264	5.752	1,77
0,400 % fällig am 15.05.2030 (b)		2.253	2.249	0,69
1,400 % fällig am 26.05.2025 (b)		10.325	11.154	3,44
2,350 % fällig am 15.09.2024 (b)		1.176	1.291	0,40
2,600 % fällig am 15.09.2023 (b)		560	610	0,19
Japan Government International Bond				
0,005 % fällig am 10.03.2031 (b)	¥	21.143	157	0,05
0,100 % fällig am 10.03.2024 (b)		427.440	3.015	0,93
0,100 % fällig am 10.03.2028 (b)		960.531	7.005	2,16
0,100 % fällig am 10.03.2029 (b)		1.662.205	12.173	3,76
Spain Government International Bond				
0,650 % fällig am 30.11.2027 (b)	€	10.869	11.646	3,59
0,700 % fällig am 30.11.2033 (b)		1.685	1.760	0,54
1,450 % fällig am 31.10.2027		300	304	0,09
United Kingdom Gilt				
0,125 % fällig am 10.08.2028 (b)	£	320	392	0,12
0,125 % fällig am 10.08.2031 (b)		1.904	2.353	0,73
0,125 % fällig am 22.11.2036 (b)		172	202	0,06
0,125 % fällig am 22.03.2039 (b)		377	427	0,13
0,125 % fällig am 10.08.2041 (b)		1.690	1.878	0,58
0,125 % fällig am 22.03.2044 (b)		615	657	0,20

BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
0,125 % fällig am 22.03.2046 (b)	£ 1.909	$ 1.993	0,61
0,125 % fällig am 10.08.2048 (b)	1.831	1.884	0,58
0,125 % fällig am 22.03.2051 (b)	481	488	0,15
0,250 % fällig am 22.03.2052 (b)	1.385	1.459	0,45
0,500 % fällig am 22.03.2050 (b)	1.449	1.637	0,50
0,625 % fällig am 22.03.2040 (b)	258	316	0,10
0,625 % fällig am 22.11.2042 (b)	877	1.060	0,33
0,750 % fällig am 22.11.2047 (b)	2.242	2.695	0,83
1,250 % fällig am 22.11.2027 (b)	2.035	2.614	0,81
1,250 % fällig am 22.11.2032 (b)	395	535	0,17
4,125 % fällig am 22.07.2030	530	849	0,26
		89.693	27,67

	AKTIEN		
STAMMAKTIEN			
KOMMUNIKATIONSDIENSTE			
Activision Blizzard, Inc.	515	43	0,01
LUXUSGÜTER			
Hilton Worldwide Holdings, Inc.	662	97	0,03
Marriott International, Inc. 'A'	486	89	0,03
		186	0,06
FINANZWERTE			
Argo Group International Holdings Ltd.	575	17	0,01
GESUNDHEITSWESEN			
Amedisys, Inc. (a)	400	37	0,01
DICE Therapeutics, Inc. (a)	600	28	0,01
Horizon Therapeutics PLC (a)	900	92	0,03
IVERIC bio, Inc. (a)	1.400	55	0,02
Seagen, Inc. (a)	425	82	0,02
		294	0,09
INFORMATIONSTECHNOLOGIE			
National Instruments Corp.	950	54	0,02
IMMOBILIEN			
Howard Hughes Corp. (a)	1.781	141	0,04
VERSORGUNGSUNTERNEHMEN			
PNM Resources, Inc.	324	15	0,00
		750	0,23
VORZUGSWERTPAPIERE			
Nationwide Building Society 10,250 %	813	119	0,04
REAL ESTATE INVESTMENT TRUSTS			
Alexandria Real Estate Equities, Inc.	2.859	324	0,10
American Assets Trust, Inc.	5.170	99	0,03
American Homes 4 Rent 'A'	12.445	$ 441	0,14
American Tower Corp.	1.566	304	0,09
Americold Realty Trust, Inc.	6.924	224	0,07
Apartment Income REIT Corp.	4.486	162	0,05
AvalonBay Communities, Inc.	3.554	673	0,21
Boston Properties, Inc.	3.562	205	0,06
Brixmor Property Group, Inc.	6.127	135	0,04
Camden Property Trust	2.887	314	0,10
Corporate Office Properties Trust	4.103	97	0,03
Cousins Properties, Inc.	3.496	80	0,02
Crown Castle, Inc.	1.277	146	0,04
CubeSmart	4.489	201	0,06
Digital Realty Trust, Inc.	4.854	553	0,17
Equinix, Inc.	1.466	1.149	0,35
Equity LifeStyle Properties, Inc.	6.736	451	0,14
Equity Residential	8.132	536	0,17
Essex Property Trust, Inc.	1.133	265	0,08
Extra Space Storage, Inc.	723	108	0,03
First Industrial Realty Trust, Inc.	8.015	422	0,13
Gaming and Leisure Properties, Inc.	8.950	434	0,13
Healthpeak Properties, Inc.	15.422	310	0,10
Highwoods Properties, Inc.	2.585	62	0,02
Host Hotels & Resorts, Inc.	15.047	253	0,08
InvenTrust Properties Corp.	3.981	92	0,03
Invitation Homes, Inc.	19.369	666	0,21
Kilroy Realty Corp.	4.967	149	0,05
Kimco Realty Corp.	13.991	276	0,08
Life Storage, Inc.	1.033	137	0,04
Mid-America Apartment Communities, Inc.	1.093	166	0,05
National Storage Affiliates Trust	5.003	174	0,05
Park Hotels & Resorts, Inc.	12.916	166	0,05
Prologis, Inc.	13.586	1.666	0,51
Public Storage	2.538	741	0,23
Realty Income Corp.	6.549	392	0,12
Regency Centers Corp.	3.650	225	0,07
Retail Opportunity Investments Corp.	9.547	129	0,04
Rexford Industrial Realty, Inc.	5.222	273	0,08
RLJ Lodging Trust	30.644	315	0,10
Ryman Hospitality Properties, Inc.	2.681	249	0,08
SBA Communications Corp.	1.490	345	0,11
Simon Property Group, Inc.	7.612	879	0,27
SITE Centers Corp.	10.160	134	0,04
Sun Communities, Inc.	3.192	416	0,13
Sunstone Hotel Investors, Inc.	14.731	149	0,05
UDR, Inc.	5.888	253	0,08
Ventas, Inc.	3.613	$ 171	0,05
VICI Properties, Inc.	27.486	864	0,27
WP Carey, Inc.	4.096	277	0,09
		17.252	5,32

	PAR (000S)		
KURZFRISTIGE INSTRUMENTE			
COMMERCIAL PAPER			
AT+T, Inc. 5,700 % fällig am 19.03.2024	$ 900	861	0,26
Conagra Foods, Inc. 5,750 % fällig am 05.07.2023	250	250	0,08
Constellation Brands, Inc. 5,580 % fällig am 25.07.2023	250	249	0,08
Dominion Resources, Inc. 5,520 % fällig am 18.08.2023	250	248	0,07
Global Payments, Inc. 5,930 % fällig am 26.07.2023	250	249	0,08
5,930 % fällig am 28.07.2023	500	498	0,15
Humana, Inc. 5,510 % fällig am 03.08.2023	250	249	0,08
National Grid Holdings Ltd. 5,450 % fällig am 13.07.2023	300	299	0,09
Targa Resources Corp. 5,950 % fällig am 26.07.2023	250	249	0,08
Trane Technologies Fing Ltd. 5,550 % fällig am 24.07.2023	500	498	0,15
VW Credit, Inc. 5,400 % fällig am 26.07.2023	250	249	0,08
5,430 % fällig am 01.08.2023	250	249	0,08
		4.148	1,28
Summe kurzfristige Instrumente		4.148	1,28
Summe Übertragbare Wertpapiere		**$ 293.906**	**90,66**

	AKTIEN		
INVESTMENTFONDS			
ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN			
PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (d)*	3.269.546	32.558	10,04
BÖRSENGEHANDELTE FONDS			
Invesco Physical Gold ETC	109.288	20.230	6,24
iShares Physical Gold ETC	288.780	10.780	3,33
		31.010	9,57
Summe Investmentfonds		**$ 63.568**	**19,61**

* Das Engagement des Inflation Multi-Asset Fund in den Anlagefonds stieg etwas über 10 %. Ab dem 3. Juli 2023 erfüllte der Fonds die Vorgaben wieder.

PENSIONSGESCHÄFTE

Kontrahent	Kredit-zins	Abrechnungs-datum	Fälligkeits-datum	Kapital-betrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensions-geschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensions-geschäft[1]	% des Nettovermögens
BOS	5,140 %	30.06.2023	03.07.2023	$ 3.300	U.S. Treasury Bonds 4,750 % fällig am 15.02.2041	$ (3.389)	$ 3.300	$ 3.301	1,02
SSB	2,400	30.06.2023	03.07.2023	801	U.S. Treasury Notes 1,875 % fällig am 30.06.2026	(817)	801	801	0,25
Summe Pensionsgeschäfte						**$ (4.206)**	**$ 4.101**	**$ 4.102**	**1,27**

(1) Umfasst aufgelaufene Zinsen.

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

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

FUTURES

Beschreibung	Art	Ablauf-monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Australia Government 3-Year Note September Futures	Short	09.2023	8	$ 3	0,00
Australia Government 10-Year Bond September Futures	Short	09.2023	1	0	0,00
Euro-Bobl September Futures	Short	09.2023	51	71	0,02
Euro-BTP Italy Government Bond September Futures	Short	09.2023	2	(2)	0,00
Euro-BTP Italy Government Bond September Futures	Short	09.2023	49	49	0,02
Euro-Bund 10-Year Bond September Futures	Long	09.2023	119	(134)	(0,04)
Euro-Buxl 30-Year Bond September Futures	Short	09.2023	53	(108)	(0,03)
Euro-OAT France Government 10-Year Bond September Futures	Short	09.2023	7	5	0,00
Euro-Schatz September Futures	Short	09.2023	693	652	0,20
Japan Government 10-Year Bond September Futures	Short	09.2023	26	(96)	(0,03)
U.S. Treasury 2-Year Note September Futures	Short	09.2023	11	26	0,01
U.S. Treasury 5-Year Note September Futures	Short	09.2023	120	241	0,07
U.S. Treasury 10-Year Note September Futures	Long	09.2023	196	(227)	(0,07)
U.S. Treasury 10-Year Ultra September Futures	Short	09.2023	147	163	0,05
U.S. Treasury 30-Year Bond September Futures	Short	09.2023	85	5	0,00
U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond September Futures	Short	09.2023	71	(117)	(0,04)
United Kingdom Long Gilt September Futures	Long	09.2023	60	(80)	(0,02)
				$ 451	0,14

VERKAUFSOPTIONEN

OPTIONEN AUF BÖRSENGEHANDELTE TERMINKONTRAKTE

Beschreibung	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Anzahl der Kontrakte	Aufgeld	Markt-wert	% des Nettovermögens
Put - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note August Futures	$ 113,000	21.07.2023	102	$ (72)	$ (114)	(0,04)
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate					**$ 337**	**0,10**

ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)

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

ZINSSWAPS

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Erhalt	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	0,500 %	16.03.2042	£ 2.200	$ 179	0,05
Zahlung	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	1,500	15.06.2052	12.100	(4.116)	(1,27)
Erhalt[1]	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	3,250	20.09.2053	7.400	670	0,21
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,000	16.06.2031	¥ 50.000	10	0,00
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,450	20.03.2029	154.390	36	0,01
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,500	15.12.2031	1.507.000	(64)	(0,02)
Erhalt[1]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,840	21.11.2028	$ 3.100	296	0,09
Zahlung[1]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,888	21.11.2053	600	(170)	(0,05)
Erhalt[1]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,865	13.02.2054	10.900	241	0,07
Zahlung[1]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,085	13.02.2034	24.600	(442)	(0,14)
Erhalt[1]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	4,250	20.12.2025	35.500	213	0,07
Zahlung	3-Month EUR-EURIBOR	0,526	21.11.2023	€ 1.500	(36)	(0,01)
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	0,190	04.11.2052	200	92	0,03
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	0,195	04.11.2052	200	104	0,03
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	0,197	08.11.2052	400	183	0,06
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	0,650	12.04.2027	600	(64)	(0,02)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	0,650	11.05.2027	300	(31)	(0,01)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	0,700	11.04.2027	300	(31)	(0,01)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	1,000	13.05.2027	600	(56)	(0,02)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	1,000	18.05.2027	200	(19)	(0,01)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,879	15.08.2032	8.400	(104)	(0,03)
Zahlung[1]	6-Month EUR-EURIBOR	3,000	20.09.2033	19.500	139	0,04
Erhalt[1]	6-Month EUR-EURIBOR	3,500	20.09.2025	39.400	(14)	0,00
Erhalt	CPTFEMU	2,359	15.08.2030	1.400	63	0,02
Erhalt	CPTFEMU	2,470	15.07.2032	1.100	53	0,02
Zahlung	CPTFEMU	2,590	15.12.2052	500	(28)	(0,01)
Erhalt	CPTFEMU	2,600	15.05.2032	2.400	112	0,03
Zahlung	CPTFEMU	2,680	15.04.2053	2.100	(31)	(0,01)
Zahlung	CPTFEMU	2,700	15.04.2053	600	(8)	0,00
Erhalt	CPTFEMU	2,720	15.06.2032	4.200	104	0,03
Erhalt	CPTFEMU	2,965	15.05.2027	10.700	407	0,12
Erhalt	CPTFEMU	2,980	15.06.2027	9.900	208	0,06
Erhalt	CPTFEMU	3,000	15.05.2027	1.900	68	0,02
Erhalt	CPTFEMU	3,130	15.05.2027	2.100	61	0,02
Zahlung	CPURNSA	1,280	19.05.2030	$ 600	(39)	(0,01)
Erhalt	CPURNSA	1,794	24.08.2027	850	59	0,02
Erhalt	CPURNSA	1,798	25.08.2027	300	21	0,01

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Erhalt	CPURNSA	1,890 %	27.08.2027	$ 500	$ 35	0,01
Zahlung	CPURNSA	1,954	03.06.2029	750	(56)	(0,02)
Zahlung	CPURNSA	2,165	16.04.2029	500	(39)	(0,01)
Erhalt	CPURNSA	2,314	26.02.2026	400	30	0,01
Zahlung	CPURNSA	2,353	09.05.2028	300	(24)	(0,01)
Zahlung	CPURNSA	2,360	09.05.2028	450	(36)	(0,01)
Zahlung	CPURNSA	2,364	10.05.2028	460	(37)	(0,01)
Zahlung	CPURNSA	2,379	09.07.2028	300	(24)	(0,01)
Erhalt	CPURNSA	2,419	05.03.2026	700	52	0,02
Erhalt	CPURNSA	2,703	25.05.2026	300	23	0,01
Erhalt	CPURNSA	2,768	13.05.2026	500	38	0,01
Erhalt	CPURNSA	2,813	14.05.2026	300	23	0,01
Zahlung	FRCPXTOB	1,280	15.11.2034	€ 200	(45)	(0,01)
Zahlung	FRCPXTOB	1,590	15.02.2028	180	(30)	(0,01)
Zahlung	UKRPI	3,480	15.01.2030	£ 800	(201)	(0,06)
Zahlung	UKRPI	3,566	15.03.2036	500	(111)	(0,03)
Zahlung	UKRPI	3,850	15.09.2024	400	(94)	(0,03)
Erhalt	UKRPI	4,143	15.10.2032	400	19	0,01
Erhalt	UKRPI	4,288	15.02.2032	2.500	280	0,09
Erhalt	UKRPI	4,595	15.08.2032	4.600	15	0,00
Erhalt	UKRPI	4,615	15.02.2027	4.900	350	0,11
Erhalt	UKRPI	4,735	15.12.2026	400	54	0,02
Erhalt	UKRPI	5,200	15.06.2024	1.300	85	0,03
Erhalt	UKRPI	5,330	15.06.2024	1.800	111	0,03
Erhalt	UKRPI	6,600	15.05.2024	800	49	0,01
					$ (1.467)	(0,45)
Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate					**$ (1.467)**	**(0,45)**

(1) Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft.

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

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

OPTIONSKAUF

ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag(1)	Kosten	Markt-wert	% des Nettovermögens
DUB	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,237 %	17.11.2023	2.300	$ 143	$ 505	0,16

VERKAUFSOPTIONEN

INFLATION-CAPPED OPTIONS

Kontrahent	Beschreibung	Anfänglicher Index	Variabler Zinssatz	Verfalls-datum	Nenn-betrag(1)	Aufgeld	Markt-wert	% des Nettovermögens
GLM	Cap - OTC CPALEMU	$ 100,151	Maximal [(Index Final/Index Initial - 1) - 3,000 %] oder 0	22.06.2035	300	$ (14)	$ (17)	(0,01)

ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag(1)	Aufgeld	Markt-wert	% des Nettovermögens
BPS	Call - OTC 2-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,750 %	12.09.2023	16.200	$ (46)	$ (19)	(0,01)
DUB	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,340	17.11.2023	11.200	(141)	(826)	(0,26)
FAR	Call - OTC 2-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	4,420	21.09.2023	38.400	(218)	(164)	(0,04)
JPM	Call - OTC 2-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,750	12.09.2023	22.700	(64)	(26)	(0,01)
							$ (469)	$ (1.035)	(0,32)

(1) Der Nennbetrag stellt die Anzahl der Kontrakte dar.

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES - SCHUTZVERKAUF(1)

Kontrahent	Index/Tranchen	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag(2)	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Markt-wert	% des Nettovermögens
GST	CMBX.NA.AAA.10 Index	0,500 %	17.11.2059	$ 200	$ (6)	$ 5	$ (1)	0,00
MYC	CMBX.NA.AAA.10 Index	0,500	17.11.2059	800	(26)	23	(3)	0,00
SAL	CMBX.NA.AAA.12 Index	0,500	17.08.2061	200	0	(2)	(2)	0,00
UAG	CMBX.NA.AAA.10 Index	0,500	17.11.2059	400	(12)	10	(2)	0,00
					$ (44)	$ 36	$ (8)	0,00

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

(2) Der maximal mögliche Betrag, den der Fonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

ZINSSWAPS

Kontrahent	Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Markt-wert	% des Nettovermögens
MYC	Erhalt	CPURNSA	1,800 %	20.07.2026	$ 600	$ 0	$ (88)	$ (88)	(0,03)
	Erhalt	CPURNSA	1,805	20.09.2026	50	0	(7)	(7)	0,00
	Erhalt	CPURNSA	1,810	19.07.2026	500	0	(72)	(72)	(0,02)
						$ 0	$ (167)	$ (167)	(0,05)

TOTAL RETURN SWAPS AUF INDIZES

Kontrahent	Zahlung/Erhalt	Wertpapier	Anzahl der Anteile oder Einheiten	Variabler Zinssatz	Nenn-betrag	Fälligkeits-datum	Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Markt-wert	% des Nettovermögens
BPS	Erhalt	TRNGLU Index	2.052	1-Month USD-LIBOR abzgl. eines bestimmten Spreads	$ 9.053	12.07.2023	$ 0	$ 243	$ 243	0,07
	Erhalt	TRNGLU Index	1.133	1-Month USD-LIBOR abzgl. eines bestimmten Spreads	4.962	29.11.2023	0	166	166	0,05
	Erhalt	BCOMTR Index	35.886	3-Month U.S. Treasury Bill-Zinssatz zzgl. eines bestimmten Spreads	8.282	15.02.2024	0	(163)	(163)	(0,05)
JPM	Erhalt	JMABDEWU Index	16.708	0,053 %	2.676	15.02.2024	0	18	18	0,01
	Erhalt	JMABNIU5 Index	95.050	0,000	16.992	15.02.2024	0	(96)	(96)	(0,03)
MAC	Erhalt	PIMCODBU Index	265.147	0,160	41.379	15.09.2023	0	(421)	(421)	(0,13)
SOG	Erhalt	TRNGLU Index	656	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	2.899	07.02.2024	0	73	73	0,02
							$ 0	$ (180)	$ (180)	(0,06)

DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung		Zu erhaltende Währung		Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
AZD	07.2023	$	403	AUD	608	$ 1	$ 0	$ 1	0,00
	08.2023	AUD	608	$	404	0	(1)	(1)	0,00
BOA	07.2023	¥	2.493.300		17.926	676	0	676	0,21
	07.2023	PLN	711		167	0	(8)	(8)	0,00
	07.2023	SEK	4.917		455	0	0	0	0,00
	07.2023	$	6.866	MXN	126.399	486	0	486	0,15
	08.2023	CNY	1.684	$	238	5	0	5	0,00
	08.2023	$	1.545	CNY	10.601	0	(78)	(78)	(0,02)
	08.2023		290	SEK	3.128	0	0	0	0,00
	09.2023	IDR	160.823	$	11	0	0	0	0,00
	09.2023	$	1.038	KRW	1.315.383	0	(36)	(36)	(0,01)
BPS	07.2023	AUD	3.186	$	2.080	0	(41)	(41)	(0,01)
	07.2023	BRL	942		189	0	(6)	(6)	0,00
	07.2023	CHF	216		242	0	0	0	0,00
	07.2023	DKK	67.210		9.683	0	(165)	(165)	(0,05)
	07.2023	€	998		1.088	0	(1)	(1)	0,00
	07.2023	TRY	5.005		193	2	0	2	0,00
	07.2023	$	288	AUD	435	1	0	1	0,00
	07.2023		19	CHF	17	0	0	0	0,00
	07.2023		1.220	CZK	26.248	0	(16)	(16)	(0,01)
	07.2023		363	€	333	0	0	0	0,00
	08.2023	AUD	435	$	288	0	(1)	(1)	0,00
	08.2023	$	242	CHF	216	0	0	0	0,00
	08.2023		1.823	CNY	12.467	0	(99)	(99)	(0,03)
	08.2023		64	ZAR	1.170	0	(2)	(2)	0,00
	09.2023	THB	6	$	0	0	0	0	0,00
	10.2023	$	457	ZAR	8.507	0	(12)	(12)	0,00
BRC	07.2023	MYR	1.065	$	227	0	(2)	(2)	0,00
	07.2023	PHP	10.498		186	0	(4)	(4)	0,00
	07.2023	$	1.926	MYR	8.837	0	(29)	(29)	(0,01)
	08.2023	HUF	63.157	$	184	1	0	1	0,00
	08.2023	$	365	COP	1.554.877	3	0	3	0,00
	08.2023		16	ZAR	298	0	0	0	0,00
	09.2023	MXN	9.026	$	517	0	(2)	(2)	0,00
	09.2023	$	730	HKD	5.700	0	(1)	(1)	0,00
CBK	07.2023	€	37.165	$	39.883	0	(664)	(664)	(0,20)
	07.2023	£	133		169	0	0	0	0,00
	07.2023	$	450	CLP	363.973	4	0	4	0,00
	07.2023		1.075	CZK	23.164	0	(12)	(12)	0,00
	07.2023		316	€	291	2	0	2	0,00
	07.2023		1.080	PHP	58.897	0	(15)	(15)	0,00
	07.2023		1.025	RON	4.632	0	(6)	(6)	0,00
	08.2023	CLP	864.597	$	1.044	0	(30)	(30)	(0,01)
	08.2023	$	1.465	CLP	1.199.044	19	0	19	0,01
	09.2023	KRW	12.894	$	10	0	0	0	0,00
CLY	07.2023	SGD	43		32	0	0	0	0,00
DUB	07.2023	$	2.556	BRL	13.847	315	0	315	0,10

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung		Zu erhaltende Währung		Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
FAR	07.2023	$	1	CLP	558	$ 0	$ 0	$ 0	0,00
GLM	07.2023	BRL	12.946	$	2.681	0	(2)	(2)	0,00
	07.2023	$	364	DKK	2.525	6	0	6	0,00
	09.2023		2.681	BRL	13.089	2	0	2	0,00
	10.2023		272	ZAR	5.096	0	(5)	(5)	0,00
JPM	07.2023	MXN	3.951	$	224	0	(5)	(5)	0,00
	07.2023	$	477	DKK	3.260	2	(1)	1	0,00
	07.2023		20.927	£	16.551	115	0	115	0,04
	07.2023		6.073	¥	868.528	0	(64)	(64)	(0,02)
	07.2023		71	PHP	3.854	0	(1)	(1)	0,00
	08.2023	£	16.551	$	20.932	0	(115)	(115)	(0,04)
	08.2023	¥	864.838		6.073	64	0	64	0,02
	08.2023	TWD	7.088		232	4	0	4	0,00
	08.2023	$	1.923	CNY	13.152	0	(103)	(103)	(0,03)
	08.2023		1.573	HUF	541.881	0	(7)	(7)	0,00
	09.2023	IDR	67.271	$	4	0	0	0	0,00
	09.2023	SGD	383		284	0	0	0	0,00
	09.2023	$	2.024	IDR	30.134.290	0	(22)	(22)	(0,01)
	09.2023		2.301	INR	189.607	4	0	4	0,00
	09.2023		446	PEN	1.641	4	0	4	0,00
	09.2023		1.001	THB	34.330	0	(26)	(26)	(0,01)
	10.2023	MXN	4.387	$	250	0	(1)	(1)	0,00
MBC	07.2023	AUD	447		295	0	(3)	(3)	0,00
	07.2023	CAD	1.717		1.269	0	(29)	(29)	(0,01)
	07.2023	$	166	€	151	0	(1)	(1)	0,00
	08.2023		4.214	TWD	128.404	0	(90)	(90)	(0,03)
	09.2023		1.912	KRW	2.438.339	0	(54)	(54)	(0,02)
MYI	07.2023	£	285	$	353	0	(9)	(9)	0,00
	07.2023	IDR	42.403		3	0	0	0	0,00
	07.2023	TRY	4.785		194	11	0	11	0,00
	07.2023	$	861	€	790	1	0	1	0,00
	07.2023		3	IDR	42.403	0	0	0	0,00
	07.2023		609	MYR	2.803	0	(7)	(7)	0,00
	07.2023		458	SEK	4.913	0	(3)	(3)	0,00
	08.2023		207	ZAR	4.017	5	0	5	0,00
	09.2023	IDR	42.440	$	3	0	0	0	0,00
	09.2023	$	857	ILS	3.076	0	(26)	(26)	(0,01)
	09.2023		497	INR	40.954	1	0	1	0,00
	09.2023		2.141	KRW	2.740.298	0	(53)	(53)	(0,02)
	09.2023		457	THB	15.648	0	(12)	(12)	0,00
RBC	07.2023	MXN	10.194	$	530	0	(64)	(64)	(0,02)
	08.2023		11.249		649	0	(1)	(1)	0,00
RYL	07.2023	$	3.372	PLN	14.293	143	0	143	0,04
SCX	07.2023	CZK	3.823	$	173	0	(2)	(2)	0,00
	07.2023	$	593	AUD	893	2	0	2	0,00
	08.2023	AUD	893	$	593	0	(2)	(2)	0,00
	08.2023	TWD	6.481		212	4	0	4	0,00
	09.2023		8.164		270	8	0	8	0,00
	09.2023	$	1.440	INR	118.584	2	0	2	0,00
	09.2023		1.029	THB	35.526	0	(19)	(19)	(0,01)
SOG	07.2023	SGD	363	$	270	2	0	2	0,00
SSB	07.2023	CLP	365.054		454	0	0	0	0,00
	08.2023	$	454	CLP	366.108	0	0	0	0,00
	09.2023	BRL	1.038	$	205	0	(8)	(8)	0,00
TOR	07.2023	¥	57.100		409	14	0	14	0,00
	07.2023	$	726	AUD	1.099	6	0	6	0,00
	07.2023		1.298	CAD	1.717	1	(1)	0	0,00
	08.2023	AUD	1.099	$	726	0	(6)	(6)	0,00
	08.2023	CAD	1.716		1.298	1	(1)	0	0,00
UAG	07.2023	£	16.133		20.104	0	(407)	(407)	(0,13)
	07.2023	$	396	AUD	599	2	0	2	0,00
	07.2023		234	CHF	210	1	0	1	0,00
	07.2023		4.965	SGD	6.557	0	(118)	(118)	(0,04)
	07.2023		2.383	TRY	54.909	0	(292)	(292)	(0,09)
	08.2023	AUD	599	$	396	0	(2)	(2)	0,00
						$ 1.920	$ (2.793)	$ (873)	(0,27)

ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklasse Class E AUD (Partially Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung		Zu erhaltende Währung		Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
AZD	07.2023	AUD	19	$	12	$ 0	$ 0	$ 0	0,00
	07.2023	$	24	AUD	36	1	0	1	0,00
	08.2023		12		19	0	0	0	0,00
BOA	07.2023	KRW	160	$	0	0	0	0	0,00
	07.2023	$	72	AUD	111	2	0	2	0,00
BPS	07.2023	AUD	103	$	68	0	0	0	0,00
	07.2023	$	37	AUD	58	1	0	1	0,00

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
	08.2023	$ 64	AUD 97	$ 0	$ 0	$ 0	0,00
BRC	07.2023	0	KRW 160	0	0	0	0,00
	08.2023	KRW 160	$ 0	0	0	0	0,00
CBK	07.2023	$ 15	AUD 23	0	0	0	0,00
SCX	07.2023	AUD 33	$ 22	0	0	0	0,00
	07.2023	$ 18	AUD 28	0	0	0	0,00
	08.2023	22	33	0	0	0	0,00
UAG	07.2023	AUD 101	$ 67	0	0	0	0,00
	08.2023	$ 67	AUD 101	0	0	0	0,00
				$ 4	$ 0	$ 4	0,00

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklassen Institutional EUR (Partially Hedged) thesaurierend, Class E EUR (Partially Hedged) thesaurierend und Class E EUR (Partially Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2023	€ 938	$ 1.022	$ 1	$ (3)	$ (2)	0,00
	07.2023	$ 17.264	€ 16.064	262	0	262	0,08
BPS	07.2023	€ 51.685	$ 56.628	240	(1)	239	0,07
	07.2023	$ 56.373	€ 52.440	840	0	840	0,27
	08.2023	54.645	49.803	0	(237)	(237)	(0,07)
CBK	07.2023	€ 16.413	$ 17.803	1	(105)	(104)	(0,03)
	08.2023	$ 13.294	€ 12.211	46	0	46	0,01
JPM	07.2023	€ 49.469	$ 54.016	44	0	44	0,01
	08.2023	$ 54.091	€ 49.469	0	(46)	(46)	(0,01)
MBC	07.2023	€ 2.928	$ 3.146	1	(49)	(48)	(0,02)
SOG	07.2023	$ 56.411	€ 52.440	801	0	801	0,25
				$ 2.236	$ (441)	$ 1.795	0,56

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklassen Institutional GBP (Partially Hedged) thesaurierend und Class E GBP (Partially Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2023	£ 385	$ 489	$ 0	$ 0	$ 0	0,00
	07.2023	KRW 10	0	0	0	0	0,00
	07.2023	$ 7	£ 6	0	0	0	0,00
BPS	07.2023	533	431	15	0	15	0,00
BRC	07.2023	11	9	0	0	0	0,00
	07.2023	2	KRW 3.074	0	0	0	0,00
	08.2023	KRW 3.070	$ 2	0	0	0	0,00
CBK	07.2023	£ 20	25	0	0	0	0,00
JPM	07.2023	1.262	1.596	0	(9)	(9)	0,00
	08.2023	$ 1.596	£ 1.262	9	0	9	0,00
MBC	07.2023	£ 63	$ 78	0	(2)	(2)	0,00
	07.2023	$ 1.762	£ 1.423	47	0	47	0,02
MYI	07.2023	1.790	1.440	41	0	41	0,01
RYL	07.2023	6	5	0	0	0	0,00
TOR	07.2023	£ 1.265	$ 1.608	0	(1)	(1)	0,00
	08.2023	$ 1.608	£ 1.265	1	0	1	0,00
UAG	07.2023	KRW 3.058	$ 2	0	0	0	0,00
				$ 113	$ (12)	$ 101	0,03

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklassen Administrative SGD (Hedged) ausschüttend II und E Class SGD (Partially Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BPS	07.2023	$ 8	SGD 11	$ 0	$ 0	$ 0	0,00
BRC	07.2023	654	885	0	0	0	0,00
GLM	07.2023	SGD 117	$ 87	1	0	1	0,00
JPM	07.2023	2.151	1.590	0	0	0	0,00
	08.2023	$ 1.590	SGD 2.149	0	0	0	0,00
MBC	07.2023	1.492	2.016	0	(3)	(3)	0,00
MYI	07.2023	SGD 2.133	$ 1.579	2	0	2	0,00
	08.2023	$ 1.544	SGD 2.085	0	(2)	(2)	0,00
UAG	07.2023	SGD 99	$ 74	1	0	1	0,00
	07.2023	$ 1.629	SGD 2.204	0	(1)	(1)	0,00
				$ 4	$ (6)	$ (2)	0,00

Summe Freiverkehrsfinanzderivate	**$ 123**	**0,04**
Summe Anlagen	**$ 360.568**	**111,23**
Sonstige Aktiva und Passiva	**$ (36.390)**	**(11,23)**
Nettovermögen	**$ 324.178**	**100,00**

ERLÄUTERUNGEN ZUR AUFSTELLUNG DES WERTPAPIERBESTANDS (Angaben in Tausend*):

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

^ **Das Wertpapier ist in Verzug.**

(a) **Das Wertpapier hat in den letzten zwölf Monaten keine Erträge geliefert.**

(b) **Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.**

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

(d) **Mit dem Fonds verbunden.**

Barmittel in Höhe von 5.441 USD (31. Dezember 2022: 5.919 USD) wurden zum 30. Juni 2023 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Barmittel in Höhe von 3.060 USD (31. Dezember 2022: 2.260 USD) wurden zum 30. Juni 2023 gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. als Sicherheit für Finanzderivate verpfändet.

Beizulegender Zeitwert[1]

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 30. Juni 2023 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie[2]	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	$ 18.002	$ 275.841	$ 63	$ 293.906
Investmentfonds	63.568	0	0	63.568
Pensionsgeschäfte	0	4.101	0	4.101
Finanzderivate[3]	360	(1.367)	0	(1.007)
Summen	**$ 81.930**	**$ 278.575**	**$ 63**	**$ 360.568**

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

Kategorie[2]	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	$ 8.543	$ 311.578	$ 0	$ 320.121
Investmentfonds	68.975	0	0	68.975
Pensionsgeschäfte	0	40.720	0	40.720
Finanzderivate[3]	1.933	2.088	0	4.021
Summen	**$ 79.451**	**$ 354.386**	**$ 0**	**$ 433.837**

(1) Weitere Informationen finden Sie in den Erläuterungen in Erläuterung 3.

(2) Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung des Wertpapierbestands.

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

Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC-Finanzderivate und -Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2023 und 31. Dezember 2022:

	Zum 30. Jun. 2023			Zum 31. Dez. 2022		
Kontrahent	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-engagement[1]	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-engagement[1]
AZD	$ 1	$ 0	$ 1	$ 1	$ 0	$ 1
BOA	1.307	(1.360)	(53)	441	(240)	201
BPS	745	(690)	55	(230)	620	390
BRC	(34)	20	(14)	170	170	340
CBK	(760)	760	0	430	(240)	190
DUB	(6)	0	(6)	(119)	0	(119)
FAR	(164)	0	(164)	k. A.	k. A.	k. A.
GLM	(15)	0	(15)	557	(550)	7
GST	(1)	0	(1)	(118)	260	142
JPM	(258)	440	182	40	400	440
MAC	(421)	890	469	192	0	192
MBC	(183)	0	(183)	375	(200)	175
MYC	(170)	260	90	(176)	260	84
MYI	(51)	0	(51)	(336)	550	214
RBC	(65)	0	(65)	(21)	0	(21)
RYL	143	0	143	k. A.	k. A.	k. A.
SAL	(2)	0	(2)	(2)	0	(2)
SCX	(7)	0	(7)	2.207	(260)	1.947
SOG	876	(650)	226	66	0	66
SSB	(8)	0	(8)	k. A.	k. A.	k. A.
TOR	14	0	14	1	0	1
UAG	(818)	690	(128)	475	(530)	(55)

(1) Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären.

Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung des Wertpapierbestands zum 30. Juni 2023:

	30. Jun. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	69,28	53,86
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	21,11	24,35
Sonstige übertragbare Wertpapiere	0,27	1,21
Investmentfonds	19,61	17,11
Pensionsgeschäfte	1,27	10,10
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	0,10	0,49
Zentral abgerechnete Finanzderivate	(0,45)	(0,47)
Freiverkehrsfinanzderivate	0,04	0,98

Das Anlageportfolio des Fonds konzentriert sich zum 30. Juni 2023 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	30. Jun. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
Unternehmensanleihen und Wechsel	2,65	3,02
US-Regierungsbehörden	17,58	10,47
US-Schatzobligationen	28,19	29,26
Non-Agency-MBS	4,19	4,06
Forderungsbesicherte Wertpapiere	3,51	3,00
Staatsemissionen	27,67	20,01
Stammaktien	0,23	0,37
Vorzugswertpapiere	0,04	0,14
Real Estate Investment Trusts	5,32	1,75
Kurzfristige Instrumente	1,28	7,34
Investmentfonds	19,61	17,11
Pensionsgeschäfte	1,27	10,10
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	0,14	0,49
Verkaufsoptionen		
Optionen auf börsengehandelte Terminkontrakte	(0,04)	k. A.
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Kreditindizes— Schutzverkauf	k. A.	0,00
Zinsswaps	(0,45)	(0,47)
Freiverkehrsfinanzderivate		
Optionskauf		
Zinsswapoptionen	0,16	0,14
Verkaufsoptionen		
Credit Default Swaptions auf Kreditindizes	k. A.	0,00
Inflation-Capped Options	(0,01)	(0,01)
Zinsswapoptionen	(0,32)	(0,23)
Credit Default Swaps auf Kreditindizes— Schutzverkauf	0,00	0,00
Zinsswaps	(0,05)	(0,04)
Total Return Swaps auf Indizes	(0,06)	(0,20)
Devisenterminkontrakte	(0,27)	0,33
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	0,59	0,99
Sonstige Aktiva und Passiva	(11,23)	(7,63)
Nettovermögen	100,00	100,00

BESCHREIBUNG		PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
BANKEN UND FINANZEN				
American Honda Finance Corp.				
5,000 % fällig am 23.05.2025	$	2.400	$ 2.391	0,27
Asian Development Bank				
6,550 % fällig am 26.01.2025	ZAR	46.000	2.333	0,26
Banco de Sabadell S.A.				
2,625 % fällig am 24.03.2026	€	3.500	3.633	0,41
Bank of Nova Scotia				
5,450 % fällig am 12.06.2025	$	1.800	1.791	0,20
Barclays PLC				
5,304 % fällig am 09.08.2026		3.500	3.416	0,39
7,325 % fällig am 02.11.2026		1.400	1.432	0,16
BNP Paribas S.A.				
4,705 % fällig am 10.01.2025		2.300	2.280	0,26
Canadian Imperial Bank of Commerce				
3,250 % fällig am 31.03.2027	€	3.400	3.643	0,41
Capital One Financial Corp.				
4,166 % fällig am 09.05.2025	$	4.000	3.898	0,44
4,985 % fällig am 24.07.2026		3.800	3.685	0,42
Citigroup, Inc.				
5,746 % fällig am 25.01.2026 (d)		2.900	2.889	0,33
Corsair International Ltd.				
7,772 % fällig am 28.01.2027	€	2.600	2.822	0,32
Coventry Building Society				
2,625 % fällig am 07.12.2026		200	210	0,02
CPI Property Group S.A.				
2,750 % fällig am 12.05.2026		2.200	1.954	0,22
Credit Suisse AG				
3,700 % fällig am 21.02.2025	$	4.000	3.825	0,43
Credit Suisse Schweiz AG				
3,390 % fällig am 05.12.2025	€	1.200	1.282	0,14
Cromwell Ereit Lux Finco SARL				
2,125 % fällig am 19.11.2025		1.975	1.860	0,21
CTP NV				
0,500 % fällig am 21.06.2025		2.300	2.237	0,25
Danske Bank A/S				
3,773 % fällig am 28.03.2025	$	4.000	3.911	0,44
Deutsche Bank AG				
3,961 % fällig am 26.11.2025		4.000	3.816	0,43
6,119 % fällig am 14.07.2026		4.000	3.957	0,45
6,309 % fällig am 16.11.2027		1.500	1.382	0,16
Equinix, Inc.				
2,625 % fällig am 18.11.2024		3.400	3.248	0,37
GA Global Funding Trust				
1,250 % fällig am 08.12.2023		3.400	3.321	0,38
3,850 % fällig am 11.04.2025		3.500	3.335	0,38
HSBC USA, Inc.				
5,625 % fällig am 17.03.2025		800	797	0,09
ING Groep NV				
3,869 % fällig am 28.03.2026		4.000	3.844	0,43
Manulife Financial Corp.				
4,150 % fällig am 04.03.2026		1.500	1.453	0,16
Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc.				
5,541 % fällig am 17.04.2026		1.900	1.889	0,21
Mizuho Financial Group, Inc.				
5,079 % fällig am 19.07.2023	AUD	4.800	3.195	0,36
6,201 % fällig am 10.07.2024	$	3.100	3.100	0,35
Morgan Stanley				
6,138 % fällig am 16.10.2026		2.700	2.728	0,31
National Bank of Canada				
3,500 % fällig am 25.04.2028	€	2.000	2.171	0,25
NatWest Group PLC				
7,472 % fällig am 10.11.2026	$	1.300	1.330	0,15
NatWest Markets PLC				
3,479 % fällig am 22.03.2025		4.000	3.838	0,43
Pricoa Global Funding				
4,200 % fällig am 28.08.2025		2.700	2.619	0,30
Santander Holdings USA, Inc.				
3,450 % fällig am 02.06.2025		2.700	2.547	0,29
Santander UK Group Holdings PLC				
6,833 % fällig am 21.11.2026		2.300	2.306	0,26
SOCAR Turkey Enerji AS Via Steas Funding DAC				
7,230 % fällig am 17.03.2026		4.000	3.910	0,44
Societe Generale S.A.				
2,625 % fällig am 22.01.2025	$	2.500	$ 2.350	0,27
Standard Chartered PLC				
1,822 % fällig am 23.11.2025		2.600	2.432	0,27
Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc.				
5,464 % fällig am 13.01.2026		3.300	3.291	0,37
Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd.				
3,629 % fällig am 06.04.2026	€	2.000	2.155	0,24
Swedbank AB				
3,356 % fällig am 04.04.2025	$	4.000	3.828	0,43
Toronto-Dominion Bank				
3,879 % fällig am 13.03.2026	€	6.700	7.300	0,82
UBS Group AG				
2,193 % fällig am 05.06.2026	$	2.400	2.202	0,25
4,125 % fällig am 24.09.2025		800	765	0,09
4,703 % fällig am 05.08.2027		1.600	1.530	0,17
UniCredit SpA				
7,830 % fällig am 04.12.2023		6.350	6.388	0,72
Wells Fargo & Co.				
2,125 % fällig am 20.12.2023	£	900	1.122	0,13
3,908 % fällig am 25.04.2026	$	2.700	2.612	0,29
4,808 % fällig am 25.07.2028		4.000	3.913	0,44
			144.166	16,27
INDUSTRIEWERTE				
Amgen, Inc.				
5,150 % fällig am 02.03.2028		500	500	0,06
5,250 % fällig am 02.03.2025		2.600	2.588	0,29
Boeing Co.				
1,950 % fällig am 01.02.2024		3.500	3.421	0,39
CommonSpirit Health				
1,547 % fällig am 01.10.2025		2.900	2.639	0,30
Continental Resources, Inc.				
2,268 % fällig am 15.11.2026		2.900	2.583	0,29
CRH America, Inc.				
3,875 % fällig am 18.05.2025		2.700	2.601	0,29
Daimler Truck Finance North America LLC				
5,691 % fällig am 14.12.2023		3.000	3.001	0,34
5,841 % fällig am 13.12.2024		2.800	2.797	0,31
Expedia Group, Inc.				
5,000 % fällig am 15.02.2026		3.393	3.347	0,38
Hyundai Capital America				
1,000 % fällig am 17.09.2024		3.000	2.823	0,32
Nissan Motor Co. Ltd.				
3,043 % fällig am 15.09.2023		3.600	3.575	0,40
Penske Truck Leasing Co. LP				
1,700 % fällig am 15.06.2026		3.300	2.916	0,33
Reliance Steel & Aluminum Co.				
1,300 % fällig am 15.08.2025		3.900	3.562	0,40
Renesas Electronics Corp.				
2,170 % fällig am 25.11.2026		2.800	2.465	0,28
SK Hynix, Inc.				
1,000 % fällig am 19.01.2024		2.900	2.819	0,32
TD SYNNEX Corp.				
1,250 % fällig am 09.08.2024		4.300	4.069	0,46
VMware, Inc.				
1,000 % fällig am 15.08.2024		2.700	2.557	0,29
WRKCo, Inc.				
3,750 % fällig am 15.03.2025		2.700	2.599	0,29
			50.862	5,74
VERSORGUNGSUNTERNEHMEN				
AES Corp.				
1,375 % fällig am 15.01.2026		3.200	2.860	0,32
Constellation Energy Generation LLC				
3,250 % fällig am 01.06.2025		2.600	2.476	0,28
Enel Finance International NV				
2,650 % fällig am 10.09.2024		4.000	3.850	0,43
6,800 % fällig am 14.10.2025		1.900	1.936	0,22
Eversource Energy				
0,800 % fällig am 15.08.2025		3.000	2.703	0,31
Pacific Gas & Electric Co.				
3,150 % fällig am 01.01.2026		3.300	3.064	0,35
3,850 % fällig am 15.11.2023 ^		1.000	991	0,11
4,250 % fällig am 01.08.2023		3.100	3.097	0,35
4,950 % fällig am 08.06.2025	$	2.500	$ 2.425	0,27
			23.402	2,64
Summe Unternehmensanleihen und Wechsel			218.430	24,65
US-REGIERUNGSBEHÖRDEN				
Fannie Mae				
0,000 % fällig am 25.04.2040 (a)(b)		120	90	0,01
1,000 % fällig am 25.01.2043		40	33	0,00
3,732 % fällig am 01.01.2035		3	3	0,00
3,867 % fällig am 01.12.2034		12	13	0,00
3,872 % fällig am 01.12.2034		3	3	0,00
3,952 % fällig am 01.07.2035		2	2	0,00
3,964 % fällig am 01.01.2035		15	15	0,00
4,036 % fällig am 01.08.2035		97	99	0,01
4,345 % fällig am 01.05.2038		549	557	0,06
4,550 % fällig am 01.03.2035		1	1	0,00
4,943 % fällig am 01.06.2043		19	19	0,00
4,944 % fällig am 01.07.2042		18	17	0,00
4,994 % fällig am 01.09.2041		44	43	0,01
5,036 % fällig am 25.07.2037		17	16	0,00
5,500 % fällig am 25.12.2036 - 25.03.2044		1.416	1.389	0,16
5,560 % fällig am 25.09.2035		119	117	0,01
5,650 % fällig am 01.01.2035		4	4	0,00
Freddie Mac				
0,000 % fällig am 15.05.2037 (a)(b)		47	41	0,00
0,650 % fällig am 22.10.2025		23.500	21.295	2,40
0,680 % fällig am 06.08.2025		11.300	10.321	1,17
0,800 % fällig am 28.10.2026		7.000	6.173	0,70
2,000 % fällig am 15.11.2026		665	651	0,07
2,920 % fällig am 25.01.2026		1.000	957	0,11
3,590 % fällig am 25.01.2025		3.592	3.496	0,39
4,000 % fällig am 01.12.2034		3	3	0,00
4,021 % fällig am 01.09.2035		52	52	0,01
4,150 % fällig am 01.01.2035		8	8	0,00
5,176 % fällig am 25.02.2045		62	60	0,01
5,323 % fällig am 01.07.2035		8	8	0,00
5,513 % fällig am 15.02.2037		17	17	0,00
5,523 % fällig am 25.09.2024		794	791	0,09
5,643 % fällig am 15.09.2041		4	4	0,00
5,683 % fällig am 25.07.2026		319	318	0,04
5,693 % fällig am 25.10.2026		293	292	0,03
6,500 % fällig am 25.07.2043		76	78	0,01
Ginnie Mae				
3,000 % fällig am 20.06.2027		9	9	0,00
3,575 % fällig am 20.07.2067		5.315	5.316	0,60
4,585 % fällig am 20.08.2070		2.494	2.523	0,29
4,643 % fällig am 20.10.2065		11	11	0,00
5,318 % fällig am 20.06.2065		919	914	0,10
5,545 % fällig am 20.04.2066		1.941	1.926	0,22
5,816 % fällig am 20.10.2072		1.939	1.928	0,22
5,866 % fällig am 20.04.2072		1.500	1.465	0,17
5,894 % fällig am 20.05.2066		1.159	1.149	0,13
5,966 % fällig am 20.01.2073		817	814	0,09
6,066 % fällig am 20.05.2073		2.003	2.006	0,23
6,144 % fällig am 20.02.2062		14	14	0,00
6,166 % fällig am 20.05.2073		4.325	4.329	0,49
6,177 % fällig am 20.08.2071		988	999	0,11
6,226 % fällig am 20.11.2072		8.250	8.335	0,94
6,236 % fällig am 20.11.2072		9.527	9.633	1,09
Uniform Mortgage-Backed Security				
3,000 % fällig am 01.02.2052		17.930	15.812	1,78
3,500 % fällig am 01.07.2047		29.816	27.555	3,11
4,000 % fällig am 01.10.2047		20	19	0,00
5,000 % fällig am 01.02.2025 - 01.10.2031		561	557	0,06
6,000 % fällig am 01.12.2023 - 01.01.2041		903	937	0,11
6,500 % fällig am 01.12.2035 - 01.01.2036		9	9	0,00
Uniform Mortgage-Backed Security, TBA				
4,000 % fällig am 01.08.2053		19.600	18.411	2,08
4,500 % fällig am 01.08.2053		42.600	40.979	4,63
5,000 % fällig am 01.08.2053		60.800	59.589	6,73
5,500 % fällig am 01.08.2053		6.300	6.269	0,71
			258.494	29,18
US-SCHATZOBLIGATIONEN				
U.S. Treasury Notes				
0,250 % fällig am 31.05.2025		27.900	25.537	2,88
0,375 % fällig am 31.01.2026 (e)		139.800	125.544	14,16

BESCHREIBUNG		PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
0,875 % fällig am 31.01.2024	$	53.300	$ 51.925	5,86
2,875 % fällig am 15.05.2032 (e)		1.800	1.670	0,19
4,125 % fällig am 31.01.2025		38.500	37.902	4,28
4,250 % fällig am 31.12.2024 (e)		183.100	180.568	20,38
4,250 % fällig am 31.05.2025 (f)		19.800	19.552	2,21
4,375 % fällig am 31.10.2024 (e)		88.200	87.151	9,83
			529.849	59,79
NON-AGENCY-MBS				
Avon Finance PLC				
5,809 % fällig am 20.09.2048	£	1.617	2.055	0,23
Banc of America Mortgage Trust				
4,020 % fällig am 25.08.2034	$	244	234	0,03
5,268 % fällig am 25.07.2034		11	10	0,00
Bear Stearns Adjustable Rate Mortgage Trust				
3,907 % fällig am 25.01.2034		6	6	0,00
4,752 % fällig am 25.07.2034		117	106	0,01
4,963 % fällig am 25.01.2035		6	5	0,00
Bear Stearns ALT-A Trust				
4,622 % fällig am 25.12.2033		26	25	0,00
5,470 % fällig am 25.02.2034		49	44	0,01
Benchmark Mortgage Trust				
3,965 % fällig am 10.04.2051		966	919	0,10
Citigroup Global Markets Mortgage Securities, Inc.				
7,000 % fällig am 25.12.2018		1	1	0,00
Citigroup Mortgage Loan Trust				
5,410 % fällig am 25.10.2035		14	13	0,00
Countrywide Alternative Loan Trust				
6,000 % fällig am 25.10.2033		9	9	0,00
Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust				
3,810 % fällig am 25.11.2034		31	28	0,00
3,864 % fällig am 20.02.2035		8	8	0,00
DBGS Mortgage Trust				
6,038 % fällig am 15.06.2033		2.800	2.608	0,30
Eurosail PLC				
5,940 % fällig am 13.06.2045	£	4.157	5.212	0,59
Formentera Issuer PLC				
5,357 % fällig am 28.07.2047		2.467	3.112	0,35
Great Hall Mortgages PLC				
5,644 % fällig am 18.06.2039	$	376	372	0,04
Bear Stearns Adjustable Rate Mortgage Trust				
4,070 % fällig am 25.09.2035		74	70	0,01
6,000 % fällig am 25.03.2032		0	0	0,00
IndyMac Mortgage Loan Trust				
5,630 % fällig am 25.04.2035		264	222	0,03
Morgan Stanley Capital Trust				
6,093 % fällig am 15.07.2035		4.260	4.211	0,48
Morgan Stanley Mortgage Loan Trust				
4,552 % fällig am 25.10.2034		283	266	0,03
Morgan Stanley Mortgage Loan Trust				
5,790 % fällig am 25.02.2035		60	56	0,01
Opteum Mortgage Acceptance Corp. Asset-Backed Pass-Through Certificates				
5,710 % fällig am 25.12.2035		276	256	0,03
Prime Mortgage Trust				
5,550 % fällig am 25.02.2034		2	2	0,00
Primrose Residential DAC				
4,189 % fällig am 24.03.2061	€	2.857	3.096	0,35
Ripon Mortgages PLC				
5,491 % fällig am 28.08.2056	£	4.437	5.620	0,63
Sequoia Mortgage Trust				
5,577 % fällig am 20.06.2036	$	218	203	0,02
5,957 % fällig am 20.10.2027		1	1	0,00
Stratton Mortgage Funding PLC				
5,391 % fällig am 20.07.2060	£	2.766	3.517	0,40
Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust				
3,934 % fällig am 25.01.2035	$	126	125	0,01
Structured Asset Mortgage Investments Trust				
5,646 % fällig am 19.07.2035	$	14	$ 13	0,00
Thornburg Mortgage Securities Trust				
5,830 % fällig am 25.04.2043		0	0	0,00
Towd Point Mortgage Funding PLC				
5,635 % fällig am 20.10.2051	£	2.261	2.878	0,33
5,841 % fällig am 20.07.2045		2.527	3.214	0,36
6,097 % fällig am 20.05.2045		4.978	6.311	0,71
WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust				
5,376 % fällig am 25.06.2042	$	4	4	0,00
5,830 % fällig am 25.01.2045		426	405	0,05
Warwick Finance Residential Mortgages PLC				
5,865 % fällig am 21.12.2049	£	929	1.175	0,13
Wells Fargo-RBS Commercial Mortgage Trust				
3,995 % fällig am 15.05.2047	$	4.300	4.188	0,47
			50.600	5,71
FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE				
Ameriquest Mortgage Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates				
6,170 % fällig am 25.10.2034		951	938	0,11
Ares European CLO DAC				
4,050 % fällig am 20.04.2032	€	3.100	3.319	0,37
Avoca CLO DAC				
3,997 % fällig am 15.10.2032		3.000	3.200	0,36
Barings Euro CLO DAC				
4,302 % fällig am 25.11.2029		997	1.082	0,12
Black Diamond CLO DAC				
4,303 % fällig am 15.05.2032		2.700	2.882	0,33
BlueMountain Fuji EUR CLO DAC				
3,897 % fällig am 15.01.2031		2.386	2.551	0,29
BNPP AM Euro CLO DAC				
4,031 % fällig am 22.07.2032		3.000	3.198	0,36
Bridgepoint CLO DAC				
4,387 % fällig am 15.01.2034		3.400	3.658	0,41
Cairn CLO DAC				
4,212 % fällig am 20.10.2028		118	129	0,01
Carbone CLO Ltd.				
6,390 % fällig am 20.01.2031	$	3.534	3.510	0,40
Carlyle Euro CLO DAC				
3,877 % fällig am 15.01.2031	€	2.190	2.339	0,26
Carlyle Global Market Strategies Euro CLO Ltd.				
4,073 % fällig am 15.11.2031		2.600	2.783	0,31
Catamaran CLO Ltd.				
6,373 % fällig am 22.04.2030	$	3.087	3.069	0,35
CBAM Ltd.				
6,280 % fällig am 17.04.2031		500	494	0,06
CIFC Funding Ltd.				
6,440 % fällig am 16.11.2030		2.121	2.113	0,24
Countrywide Asset-Backed Certificates Trust				
6,200 % fällig am 25.11.2034		418	413	0,05
Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp.				
4,599 % fällig am 25.01.2032		7	6	0,00
Fortress Investment Group LLC				
6,917 % fällig am 23.02.2039		7.200	6.952	0,78
Gallatin CLO Ltd.				
6,311 % fällig am 21.01.2028		940	939	0,11
GoldenTree Loan Management EUR CLO DAC				
4,100 % fällig am 20.01.2032	€	2.500	2.660	0,30
GoldenTree Loan Opportunities Ltd.				
6,370 % fällig am 20.07.2031	$	2.650	2.630	0,30
Greystone Commercial Real Estate Notes Ltd.				
6,373 % fällig am 15.09.2037	$	1.352	1.334	0,15
Griffith Park CLO DAC				
4,103 % fällig am 21.11.2031	€	3.000	3.211	0,36
Harvest CLO DAC				
4,250 % fällig am 26.06.2030		2.659	2.842	0,32
Jubilee CLO DAC				
3,787 % fällig am 15.04.2030	€	4.000	$ 4.277	0,48
Madison Park Euro Funding DAC				
3,927 % fällig am 15.01.2032		2.700	2.884	0,33
Marble Point CLO Ltd.				
6,442 % fällig am 18.12.2030	$	3.502	3.451	0,39
Nassau Ltd.				
6,410 % fällig am 15.10.2029		1.273	1.271	0,14
OCP Euro CLO DAC				
4,713 % fällig am 20.01.2033	€	2.000	2.179	0,25
Octagon Loan Funding Ltd.				
6,525 % fällig am 18.11.2031	$	3.400	3.368	0,38
Palmer Square European Loan Funding DAC				
3,897 % fällig am 15.10.2031	€	2.533	2.709	0,31
3,907 % fällig am 15.07.2031		2.188	2.332	0,26
4,727 % fällig am 15.11.2032		3.250	3.545	0,40
Saranac CLO Ltd.				
7,120 % fällig am 22.06.2030	$	2.681	2.656	0,30
SLM Student Loan Trust				
5,405 % fällig am 25.10.2029		370	369	0,04
Tikehau CLO DAC				
4,144 % fällig am 04.08.2034	€	2.300	2.452	0,28
Toro European CLO DAC				
3,995 % fällig am 12.01.2032		2.500	2.675	0,30
4,133 % fällig am 15.02.2034		3.200	3.398	0,38
Venture CLO Ltd.				
6,350 % fällig am 20.01.2029	$	2.490	2.473	0,28
			96.291	10,87
Summe Übertragbare Wertpapiere			**$ 1.153.664**	**130,20**

	AKTIEN		
INVESTMENTFONDS			
ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN			
PIMCO Funds: Global Investors Series plc - US Short-Term Fund (c)	3.280.181	32.933	3,72
PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (c)	307.203	3.059	0,34
		35.992	4,06
BÖRSENGEHANDELTE FONDS			
PIMCO ETFs plc - PIMCO US Dollar Short Maturity UCITS ETF (c)	484.660	48.141	5,44
Summe Investmentfonds		**$ 84.133**	**9,50**

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

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

FUTURES

Beschreibung	Art	Ablauf-monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Euro-Bobl September Futures	Short	09.2023	91	$ 150	0,02
Japan Government 10-Year Bond September Futures	Short	09.2023	42	(152)	(0,02)
U.S. Treasury 2-Year Note September Futures	Long	09.2023	1.073	(3.156)	(0,36)
U.S. Treasury 5-Year Note September Futures	Long	09.2023	297	(591)	(0,07)
U.S. Treasury 10-Year Note September Futures	Short	09.2023	779	1.556	0,18
U.S. Treasury 10-Year Ultra September Futures	Short	09.2023	544	411	0,05
				$ (1.782)	(0,20)
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate				**$ (1.782)**	**(0,20)**

ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)

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

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMMISSIONEN - SCHUTZVERKAUF[1]

Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag[3]	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Ford Motor Credit Co. LLC	5,000 %	20.12.2024	$ 1.000	$ 6	0,00

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZKAUF[2]

Index/Tranchen	Zu bezahlender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag[3]	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
CDX.HY-38 5-Year Index	(5,000) %	20.06.2027	$ 10.094	$ (298)	(0,04)
CDX.IG-39 5-Year Index	(1,000)	20.12.2027	9.700	(86)	(0,01)
CDX.IG-40 5-Year Index	(1,000)	20.06.2028	112.100	(816)	(0,09)
				$ (1.200)	(0,14)

ZINSSWAPS

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Zahlung	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,000 %	17.03.2024	¥ 5.680.000	$ (71)	(0,01)
Zahlung	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,380	18.06.2028	90.000	(9)	0,00
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,000	21.12.2032	$ 3.930	141	0,02
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,340	23.02.2030	2.900	(72)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,470	22.02.2030	1.100	(19)	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,525	02.03.2030	1.200	(17)	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,800	10.03.2028	1.800	(15)	0,00
Erhalt[4]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	4,270	13.09.2024	5.000	47	0,01
Erhalt[4]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	4,350	14.09.2024	3.200	28	0,00
Zahlung	3-Month NZD-BBR	4,000	14.06.2024	NZD 279.100	(2.375)	(0,27)
Zahlung[4]	3-Month NZD-BBR	4,500	13.09.2024	8.800	(66)	(0,01)
					$ (2.428)	(0,27)
Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate					**$ (3.622)**	**(0,41)**

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

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

(3) Der maximal mögliche Betrag, den der Fonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

(4) Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft.

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

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

OPTIONSKAUF

ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag[1]	Kosten	Markt-wert	% des Nettovermögens
BOA	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,750 %	12.09.2023	12.600	$ 101	$ 184	0,02
FAR	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,750	11.09.2023	11.800	88	170	0,02
							$ 189	$ 354	0,04

VERKAUFSOPTIONEN

ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag[1]	Aufgeld	Markt-wert	% des Nettovermögens
BOA	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,250 %	12.09.2023	12.600	$ (63)	$ (125)	(0,01)
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,750	12.09.2023	12.600	(38)	(71)	(0,01)
FAR	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,233	11.09.2023	11.800	(55)	(119)	(0,01)
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,715	11.09.2023	11.800	(33)	(70)	(0,01)
GLM	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,088	03.11.2023	26.600	(193)	(5)	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,088	03.11.2023	26.600	(193)	(514)	(0,06)
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,250	17.11.2023	40.700	(148)	(4)	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,750	17.11.2023	40.700	(148)	(529)	(0,06)
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,250	07.12.2023	14.800	(46)	(2)	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,750	07.12.2023	14.800	(46)	(185)	(0,02)
MYC	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,715	11.09.2023	10.700	(30)	(64)	(0,01)
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,993	11.10.2023	53.500	(361)	(10)	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,993	11.10.2023	53.500	(361)	(1.127)	(0,13)
							$ (1.715)	$ (2.825)	(0,32)

(1) Der Nennbetrag stellt die Anzahl der Kontrakte dar.

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMMISSIONEN - SCHUTZVERKAUF[1]

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag[2]	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Markt-wert	% des Nettovermögens
BOA	South Africa Government International Bond	1,000 %	20.12.2026	$ 2.000	$ (94)	$ 23	$ (71)	(0,01)
CBK	South Africa Government International Bond	1,000	20.12.2026	5.600	(270)	72	(198)	(0,02)
MYC	Colombia Government International Bond	1,000	20.06.2027	1.900	(108)	50	(58)	(0,01)
	Colombia Government International Bond	1,000	20.12.2027	2.300	(205)	104	(101)	(0,01)
	South Africa Government International Bond	1,000	20.12.2026	4.200	(195)	47	(148)	(0,02)
					$ (872)	$ 296	$ (576)	(0,07)

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

(2) Der maximal mögliche Betrag, den der Fonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung		Zu erhaltende Währung		Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
AZD	07.2023	AUD	373	$	244	$ 0	$ (4)	$ (4)	0,00
	07.2023	$	513	AUD	773	2	0	2	0,00
	08.2023	AUD	773	$	514	0	(2)	(2)	0,00
BOA	08.2023	¥	54.000		383	7	0	7	0,00
	08.2023	NZD	615		390	13	0	13	0,00
	08.2023	$	588	€	545	8	0	8	0,00
BPS	07.2023		1.357	AUD	2.016	2	(17)	(15)	0,00
	08.2023	AUD	553	$	366	0	(2)	(2)	0,00
	08.2023	$	4	CNY	29	0	0	0	0,00
	08.2023		5.132	€	4.767	80	0	80	0,01
	08.2023		179	ZAR	3.332	0	(3)	(3)	0,00
BRC	08.2023	£	1.157	$	1.452	0	(19)	(19)	0,00
	08.2023	$	277	¥	36.619	0	(22)	(22)	0,00
	08.2023		218	ZAR	4.032	0	(6)	(6)	0,00
	09.2023		20	ILS	71	0	(1)	(1)	0,00
CBK	08.2023	CNH	169	$	24	1	0	1	0,00
	08.2023	€	104		114	0	0	0	0,00
	08.2023	$	101	PEN	393	8	0	8	0,00
DUB	07.2023		4.847	BRL	26.265	596	0	596	0,07
	10.2023	ZAR	78.208	$	4.295	198	0	198	0,02
GLM	07.2023	BRL	26.348		5.457	0	(5)	(5)	0,00

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung		Zu erhaltende Währung		Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
	09.2023	$	5.457	BRL	26.640	$ 4	$ 0	$ 4	0,00
JPM	08.2023	£	12.768	$	16.171	0	(65)	(65)	(0,01)
	08.2023	$	1.000	£	808	27	0	27	0,00
	09.2023	PEN	1.470	$	399	0	(4)	(4)	0,00
	09.2023	$	19	ILS	68	0	(1)	(1)	0,00
MBC	08.2023	€	89.562	$	98.830	915	0	915	0,10
MYI	07.2023	$	1.299	€	1.192	1	0	1	0,00
	07.2023		53	£	42	0	0	0	0,00
	08.2023	NZD	830	$	521	13	0	13	0,00
	08.2023	$	3.946	¥	524.367	0	(294)	(294)	(0,03)
	08.2023		211	ZAR	4.086	5	0	5	0,00
RBC	08.2023	£	2.468	$	3.118	0	(20)	(20)	0,00
	08.2023	MXN	1.115		64	0	0	0	0,00
SCX	07.2023	AUD	1.650		1.078	0	(20)	(20)	0,00
	07.2023	$	754	AUD	1.136	2	0	2	0,00
	08.2023	AUD	1.136	$	755	0	(2)	(2)	0,00
	08.2023	CNH	319		46	3	0	3	0,00
	08.2023	NZD	218		136	3	0	3	0,00
SOG	07.2023	AUD	2.461		1.610	0	(28)	(28)	0,00
TOR	07.2023		1.302		852	0	(15)	(15)	0,00
	07.2023	$	923	AUD	1.398	7	0	7	0,00
	08.2023	AUD	1.398	$	924	0	(7)	(7)	0,00
	08.2023	NZD	526		328	6	0	6	0,00
	08.2023	$	1.821	¥	241.503	0	(140)	(140)	(0,02)
UAG	07.2023	AUD	298	$	195	0	(3)	(3)	0,00
	07.2023	$	446	AUD	674	3	0	3	0,00
	08.2023	AUD	674	$	446	0	(3)	(3)	0,00
	08.2023	£	11.184		14.136	0	(86)	(86)	(0,01)
	08.2023	$	2.161	ZAR	41.491	27	(1)	26	0,00
	09.2023		16	ILS	59	0	(1)	(1)	0,00
	10.2023	ZAR	25.203	$	1.361	41	0	41	0,01
						$ 1.972	$ (771)	$ 1.201	0,14

ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklassen Institutional EUR (Hedged) thesaurierend, Institutional EUR (Hedged) ausschüttend und Class E EUR (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung		Zu erhaltende Währung		Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2023	€	310	$	338	$ 0	$ (1)	$ (1)	0,00
	07.2023	$	19.673	€	18.305	298	0	298	0,04
BPS	07.2023	€	19.585	$	21.450	83	0	83	0,01
	07.2023	$	19.672	€	18.300	293	0	293	0,03
	08.2023		18.696		17.039	0	(81)	(81)	(0,01)
CBK	07.2023	€	18.165	$	19.759	4	(63)	(59)	(0,01)
	07.2023	$	120	€	112	2	0	2	0,00
	08.2023		18.135		16.657	63	0	63	0,01
CLY	07.2023	€	2.917	$	3.123	0	(59)	(59)	(0,01)
JPM	07.2023		16.657		18.188	15	0	15	0,00
	08.2023	$	18.213	€	16.657	0	(16)	(16)	0,00
MBC	07.2023	€	112	$	121	0	(1)	(1)	0,00
	07.2023	$	2.830	€	2.646	57	0	57	0,01
SOG	07.2023		19.686		18.300	279	0	279	0,03
						$ 1.094	$ (221)	$ 873	0,10

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklassen Institutional GBP (Hedged) thesaurierend und Institutional GBP (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung		Zu erhaltende Währung		Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BPS	07.2023	$	9.062	£	7.327	$ 253	$ 0	$ 253	0,03
BRC	07.2023	£	15	$	19	0	0	0	0,00
	07.2023	$	17	£	14	0	0	0	0,00
CBK	07.2023	£	99	$	126	0	0	0	0,00
	07.2023	$	179	£	140	0	(1)	(1)	0,00
JPM	07.2023	£	7.287	$	9.213	0	(51)	(51)	(0,01)
	08.2023	$	9.215	£	7.287	51	0	51	0,01
MBC	07.2023		9.070		7.327	245	0	245	0,03
MYI	07.2023		9.041		7.274	207	0	207	0,02
TOR	07.2023	£	7.307	$	9.285	0	(5)	(5)	0,00
	08.2023	$	9.287	£	7.307	5	0	5	0,00
						$ 761	$ (57)	$ 704	0,08
Summe Freiverkehrsfinanzderivate								**$ (269)**	**(0,03)**

LEERVERKAUFTE WERTPAPIERE

BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
US-REGIERUNGSBEHÖRDEN			
Uniform Mortgage-Backed Security, TBA			
3,000 % fällig am 01.08.2053	$ 24.500	$ (21.597)	(2,44)
3,500 % fällig am 01.08.2053	31.000	(28.282)	(3,19)
Summe Leerverkaufte Wertpapiere		**$ (49.879)**	**(5,63)**
Summe Anlagen		**$ 1.182.245**	**133,43**
Sonstige Aktiva und Passiva		**$ (296.233)**	**(33,43)**
Nettovermögen		**$ 886.012**	**100,00**

ERLÄUTERUNGEN ZUR AUFSTELLUNG DES WERTPAPIERBESTANDS (Angaben in Tausend*):

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

^ **Das Wertpapier ist in Verzug.**

(a) **Reines Kapitalwertpapier.**

(b) **Nullkuponwertpapier.**

(c) **Mit dem Fonds verbunden.**

(d) **Eingeschränkte Wertpapiere (31. Dezember 2022: 0,26 %):**

Emittentenbeschreibung	Kupon	Fälligkeits-datum	Kauf-datum	Kosten	Markt-wert	% des Nettovermögens
Citigroup, Inc.	5,746 %	25.01.2026	18.01.2022	$ 2.900	$ 2.889	0,33

(e) **Wertpapiere mit einem gesamten beizulegenden Zeitwert von 221.382 USD (31. Dezember 2022: 143.852 USD) wurden zum 30. Juni 2023 gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte als Sicherheit verpfändet.**

(f) **Wertpapier mit einem gesamten beizulegenden Zeitwert von 19.552 USD (31. Dezember 2022: 4.050 USD) wurde zum 30. Juni 2023 gemäß den Rahmenverträgen für Wertpapier-Termingeschäfte für verzögert gelieferte Wertpapiere oder Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte als Sicherheit verpfändet oder geliefert.**

Barmittel in Höhe von 9.570 USD (31. Dezember 2022: 16.925 USD) wurden zum 30. Juni 2023 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Barmittel in Höhe von 2.031 USD (31. Dezember 2022: 5.301 USD) wurden zum 30. Juni 2023 gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. als Sicherheit für Finanzderivate verpfändet.

Beizulegender Zeitwert[1]

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 30. Juni 2023 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie[2]	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	$ 0	$ 1.153.092	$ 572	$ 1.153.664
Investmentfonds	84.133	0	0	84.133
Finanzderivate[3]	(2)	(5.671)	0	(5.673)
Leerverkaufte Wertpapiere	0	(49.879)	0	(49.879)
Summen	**$ 84.131**	**$ 1.097.542**	**$ 572**	**$ 1.182.245**

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

Kategorie[2]	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	$ 0	$ 1.234.805	$ 801	$ 1.235.606
Investmentfonds	37.618	48.013	0	85.631
Pensionsgeschäfte	0	956	0	956
Finanzderivate[3]	1.960	(9.079)	0	(7.119)
Leerverkaufte Wertpapiere	0	(76.949)	0	(76.949)
Summen	**$ 39.578**	**$ 1.197.746**	**$ 801**	**$ 1.238.125**

(1) Weitere Informationen finden Sie in den Erläuterungen in Erläuterung 3.

(2) Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung des Wertpapierbestands.

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

Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2023:

Kontrahent	Kredit-zins	Abrechnungs-datum	Fälligkeits-datum	Kredit-betrag	Verbindlichkeiten aus umgekehrten Pensions-geschäften	% des Nettovermögens
BOS	5,180 %	14.06.2023	05.07.2023	$ (26.570)	$ (26.635)	(3,00)
	5,180	15.06.2023	13.07.2023	(139.826)	(140.148)	(15,82)
	5,180	20.06.2023	13.07.2023	(3.026)	(3.031)	(0,34)
GRE	5,180	22.06.2023	06.07.2023	(52.104)	(52.171)	(5,89)
Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte					**$ (221.985)**	**(25,05)**

Ausstehende Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte zum 30. Juni 2023:

Kontrahent	Kredit-zins	Abrechnungs-datum	Fälligkeits-datum	Kredit-betrag	Zahlbar für Rückkauf-Finanzierungs-geschäfte[1]	% des Nettovermögens
BPG	4,900 %	28.06.2023	05.07.2023	$ (19.666)	$ (19.674)	(2,22)
Summe Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte					**$ (19.674)**	**(2,22)**

(1) In dem für Rückkaufgeschäfte zahlbaren Betrag sind 11 USD für einen aufgeschobenen Kursrückgang enthalten.

Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC-Finanzderivate und -Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2023 und 31. Dezember 2022:

	Zum 30. Jun. 2023			Zum 31. Dez. 2022		
Kontrahent	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-engagement[1]	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-engagement[1]
AZD	$ (4)	$ 10	$ 6	$ k. A.	$ k. A.	$ k. A.
BOA	242	(340)	(98)	(1.233)	1.360	127
BPS	608	(690)	(82)	(2.779)	2.650	(129)
BRC	(48)	30	(18)	8	0	8
CBK	(184)	200	16	903	(890)	13
CLY	(59)	0	(59)	k. A.	k. A.	k. A.
DUB	794	(660)	134	k. A.	k. A.	k. A.
FAR	(19)	0	(19)	(22)	0	(22)
GLM	(1.240)	1.051	(189)	(802)	751	(51)
JPM	(44)	0	(44)	97	(190)	(93)
MBC	1.216	(1.310)	(94)	1.204	(980)	224
MYC	(1.508)	730	(778)	(1.239)	510	(729)
MYI	(68)	0	(68)	(103)	30	(73)
RBC	(20)	0	(20)	(1)	0	(1)
SAL	k. A.	k. A.	k. A.	(4)	0	(4)
SCX	(14)	10	(4)	277	(230)	47
SOG	251	(290)	(39)	k. A.	k. A.	k. A.
TOR	(149)	0	(149)	5	(10)	(5)
UAG	(23)	0	(23)	215	0	215

(1) Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären.

Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung des Wertpapierbestands zum 30. Juni 2023:

	30. Jun. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	89,92	70,91
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	40,28	43,49
Sonstige übertragbare Wertpapiere	k. A.	0,78
Investmentfonds	9,50	7,98
Pensionsgeschäfte	k. A.	0,09
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	(0,20)	0,21
Zentral abgerechnete Finanzderivate	(0,41)	(0,55)
Freiverkehrsfinanzderivate	(0,03)	(0,32)
Leerverkaufte Wertpapiere	(5,63)	(7,17)
Umgekehrte Pensionsgeschäfte	(25,05)	(13,50)
Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte	(2,22)	(0,38)

Das Anlageportfolio des Fonds konzentriert sich zum 30. Juni 2023 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	30. Jun. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
Unternehmensanleihen und Wechsel	24,65	28,04
US-Regierungsbehörden	29,18	22,99
US-Schatzobligationen	59,79	47,28
Non-Agency-MBS	5,71	6,37
Forderungsbesicherte Wertpapiere	10,87	9,23
Kurzfristige Instrumente	k. A.	1,27
Investmentfonds	9,50	7,98
Pensionsgeschäfte	k. A.	0,09
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	(0,20)	0,21

Anlagen zum Marktwert	30. Jun. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	0,00	0,00
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzkauf	(0,14)	(0,07)
Zinsswaps	(0,27)	(0,48)
Freiverkehrsfinanzderivate		
Optionskauf		
Zinsswapoptionen	0,04	0,03
Verkaufsoptionen		
Zinsswapoptionen	(0,32)	(0,19)
Optionen auf Wertpapiere	k. A.	0,00
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	(0,07)	(0,07)
Devisenterminkontrakte	0,14	(0,27)
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	0,18	0,18
Leerverkaufte Wertpapiere	(5,63)	(7,17)
Sonstige Aktiva und Passiva	(33,43)	(15,42)
Nettovermögen	100,00	100,00

BESCHREIBUNG		PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE				
KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG				
Delos Finance SARL				
7,288 % fällig am 06.10.2023	$	420	$ 420	0,05
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
BANKEN UND FINANZEN				
ABN AMRO Bank NV				
3,625 % fällig am 10.01.2026	€	700	755	0,09
Aegon Bank NV				
0,625 % fällig am 21.06.2024		3.300	3.477	0,44
AerCap Ireland Capital DAC				
1,150 % fällig am 29.10.2023	$	1.700	1.673	0,21
2,875 % fällig am 14.08.2024		700	673	0,08
Ally Financial, Inc.				
1,450 % fällig am 02.10.2023		500	493	0,06
AMCO - Asset Management Co. SpA				
4,625 % fällig am 06.02.2027	€	1.400	1.518	0,19
American Honda Finance Corp.				
5,000 % fällig am 23.05.2025	$	1.800	1.793	0,22
American Tower Corp.				
1,450 % fällig am 15.09.2026		4.000	3.523	0,44
3,650 % fällig am 15.03.2027		900	844	0,11
5,250 % fällig am 15.07.2028		1.000	989	0,12
Ares Capital Corp.				
2,875 % fällig am 15.06.2027		800	694	0,09
Assurant, Inc.				
4,200 % fällig am 27.09.2023		250	248	0,03
Athene Global Funding				
5,790 % fällig am 24.05.2024		2.500	2.476	0,31
Aviation Capital Group LLC				
4,375 % fällig am 30.01.2024		800	787	0,10
5,500 % fällig am 15.12.2024		700	686	0,09
Avolon Holdings Funding Ltd.				
2,528 % fällig am 18.11.2027		529	447	0,06
Banca Monte dei Paschi di Siena SpA				
1,875 % fällig am 09.01.2026	€	900	874	0,11
2,625 % fällig am 28.04.2025		500	512	0,06
3,625 % fällig am 24.09.2024		4.100	4.347	0,54
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A.				
0,875 % fällig am 18.09.2023	$	1.400	1.386	0,17
Banco BTG Pactual S.A.				
4,500 % fällig am 10.01.2025		500	483	0,06
Banco de Sabadell S.A.				
5,125 % fällig am 10.11.2028	€	600	660	0,08
Banco Santander Chile				
2,700 % fällig am 10.01.2025	$	500	479	0,06
Bank of America Corp.				
2,375 % fällig am 19.06.2024	€	10.200	10.951	1,37
5,080 % fällig am 20.01.2027	$	2.300	2.266	0,28
Bank of Ireland Group PLC				
6,253 % fällig am 16.09.2026		1.100	1.093	0,14
Bank Rakyat Indonesia Persero Tbk PT				
4,625 % fällig am 20.07.2023		700	700	0,09
Banque Federative du Credit Mutuel S.A.				
4,875 % fällig am 25.09.2025	£	3.000	3.658	0,46
Barclays PLC				
3,375 % fällig am 02.04.2025	€	400	431	0,05
BGC Partners, Inc.				
8,000 % fällig am 25.05.2028	$	400	387	0,05
Blackstone Private Credit Fund				
2,350 % fällig am 22.11.2024		900	841	0,11
4,700 % fällig am 24.03.2025		700	675	0,08
BNP Paribas S.A.				
2,219 % fällig am 09.06.2026		1.500	1.388	0,17
3,800 % fällig am 10.01.2024		500	494	0,06
BPCE S.A.				
1,625 % fällig am 14.01.2025		1.075	1.004	0,13
1,652 % fällig am 06.10.2026		300	269	0,03
3,625 % fällig am 17.04.2026	€	600	644	0,08
5,700 % fällig am 22.10.2023	$	800	797	0,10
5,975 % fällig am 18.01.2027		2.800	2.775	0,35
Canadian Imperial Bank of Commerce				
5,490 % fällig am 14.12.2023		700	699	0,09
Cantor Fitzgerald LP				
4,500 % fällig am 14.04.2027	$	600	$ 561	0,07
Charles Schwab Corp.				
0,750 % fällig am 18.03.2024		2.600	2.509	0,31
5,590 % fällig am 18.03.2024		1.500	1.496	0,19
China Construction Bank Europe S.A.				
0,000 % fällig am 28.06.2024 (c)	€	2.800	2.919	0,37
Citigroup, Inc.				
2,014 % fällig am 25.01.2026 (f)	$	2.000	1.880	0,24
3,290 % fällig am 17.03.2026 (f)		3.200	3.062	0,38
Cooperatieve Rabobank UA				
2,625 % fällig am 22.07.2024		300	290	0,04
Corebridge Financial, Inc.				
3,650 % fällig am 05.04.2027		1.800	1.682	0,21
Credit Agricole S.A.				
0,500 % fällig am 24.06.2024	€	2.300	2.426	0,30
Credit Suisse AG				
4,750 % fällig am 09.08.2024	$	300	293	0,04
6,500 % fällig am 08.08.2023 (e)		1.400	1.395	0,17
7,950 % fällig am 09.01.2025		3.000	3.062	0,38
Cromwell Ereit Lux Finco SARL				
2,125 % fällig am 19.11.2025	€	1.600	1.507	0,19
CTP NV				
0,500 % fällig am 21.06.2025		100	97	0,01
0,875 % fällig am 20.01.2026		2.100	1.956	0,25
DAE Sukuk Difc Ltd.				
3,750 % fällig am 15.02.2026	$	700	666	0,08
Danske Bank A/S				
6,600 % fällig am 12.09.2023		2.100	2.103	0,26
Deutsche Bank AG				
1,447 % fällig am 01.04.2025 (f)		1.600	1.521	0,19
2,129 % fällig am 24.11.2026 (f)		500	445	0,06
3,961 % fällig am 26.11.2025		2.700	2.576	0,32
EPR Properties				
4,500 % fällig am 01.06.2027		400	359	0,05
Equitable Financial Life Global Funding				
5,500 % fällig am 02.12.2025		3.200	3.160	0,40
Extra Space Storage LP				
5,700 % fällig am 01.04.2028		400	400	0,05
F&G Global Funding				
2,300 % fällig am 11.04.2027		1.000	885	0,11
Fifth Third Bancorp				
2,375 % fällig am 28.01.2025		500	468	0,06
Ford Motor Credit Co. LLC				
1,744 % fällig am 19.07.2024	€	100	106	0,01
2,386 % fällig am 17.02.2026		300	308	0,04
3,021 % fällig am 06.03.2024		800	862	0,11
3,250 % fällig am 15.09.2025		200	210	0,03
4,174 % fällig am 01.12.2024		1.100	1.186	0,15
4,535 % fällig am 06.03.2025	£	600	725	0,09
4,950 % fällig am 28.05.2027	$	500	472	0,06
Freedom Mortgage Corp.				
8,125 % fällig am 15.11.2024		400	397	0,05
FS KKR Capital Corp.				
1,650 % fällig am 12.10.2024		800	744	0,09
2,625 % fällig am 15.01.2027		400	341	0,04
GA Global Funding Trust				
1,000 % fällig am 08.04.2024		1.400	1.336	0,17
Gaci First Investment Co.				
4,750 % fällig am 14.02.2030		1.200	1.183	0,15
General Motors Financial Co., Inc.				
5,150 % fällig am 15.08.2026	£	1.400	1.689	0,21
6,290 % fällig am 17.11.2023	$	2.900	2.902	0,36
Goldman Sachs Group, Inc.				
3,850 % fällig am 08.07.2024		2.000	1.962	0,25
5,749 % fällig am 24.01.2025		1.600	1.598	0,20
Groupe Bruxelles Lambert NV				
1,875 % fällig am 19.06.2025	€	1.700	1.776	0,22
Hamburg Commercial Bank AG				
4,875 % fällig am 17.03.2025		1.700	1.849	0,23
6,250 % fällig am 18.11.2024		2.000	2.190	0,27
HSBC Holdings PLC				
3,019 % fällig am 15.06.2027		1.000	1.040	0,13
Hudson Pacific Properties LP				
5,950 % fällig am 15.02.2028	$	500	398	0,05
ING Belgium S.A.				
3,375 % fällig am 31.05.2027	€	2.300	$ 2.491	0,31
ING Groep NV				
1,000 % fällig am 20.09.2023		2.000	2.169	0,27
Intesa Sanpaolo SpA				
5,017 % fällig am 26.06.2024	$	2.200	2.132	0,27
7,000 % fällig am 21.11.2025		600	606	0,08
Jackson National Life Global Funding				
1,750 % fällig am 12.01.2025		1.000	929	0,12
John Deere Capital Corp.				
5,202 % fällig am 11.10.2024		1.000	999	0,13
JPMorgan Chase & Co.				
5,690 % fällig am 10.12.2025		1.600	1.594	0,20
KeyBank N.A.				
5,432 % fällig am 03.01.2024		250	246	0,03
Kilroy Realty LP				
3,450 % fällig am 15.12.2024		800	758	0,10
LeasePlan Corp. NV				
0,125 % fällig am 13.09.2023	€	3.600	3.898	0,49
2,875 % fällig am 24.10.2024	$	1.500	1.430	0,18
Lloyds Banking Group PLC				
4,050 % fällig am 16.08.2023		2.000	1.996	0,25
Logicor Financing SARL				
0,750 % fällig am 15.07.2024	€	400	416	0,05
1,625 % fällig am 15.07.2027		800	726	0,09
2,250 % fällig am 13.05.2025		300	305	0,04
Lseg Netherlands BV				
0,000 % fällig am 06.04.2025 (c)		1.000	1.017	0,13
LSEGA Financing PLC				
1,375 % fällig am 06.04.2026	$	1.600	1.428	0,18
MassMutual Global Funding				
0,480 % fällig am 28.08.2023		1.900	1.886	0,24
4,500 % fällig am 10.04.2026		1.000	978	0,12
Metropolitan Life Global Funding				
0,375 % fällig am 09.04.2024	€	2.100	2.231	0,28
0,450 % fällig am 01.09.2023	$	300	297	0,04
Mitsubishi HC Capital, Inc.				
3,960 % fällig am 19.09.2023		200	199	0,02
5,080 % fällig am 15.09.2027		1.200	1.173	0,15
Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc.				
3,273 % fällig am 19.09.2025	€	2.300	2.472	0,31
6,128 % fällig am 26.07.2023	$	3.000	3.001	0,38
Mizuho Financial Group, Inc.				
1,020 % fällig am 11.10.2023	€	400	433	0,05
5,628 % fällig am 13.06.2028	£	2.100	2.542	0,32
Morgan Stanley				
4,656 % fällig am 02.03.2029	€	2.100	2.305	0,29
5,686 % fällig am 24.01.2025	$	455	454	0,06
Morgan Stanley Bank N.A.				
4,754 % fällig am 21.04.2026		3.000	2.957	0,37
Nasdaq, Inc.				
5,650 % fällig am 28.06.2025		500	502	0,06
National Bank of Canada				
5,579 % fällig am 06.08.2024		1.500	1.497	0,19
Nationwide Mutual Insurance Co.				
7,842 % fällig am 15.12.2024		450	450	0,06
NatWest Group PLC				
5,847 % fällig am 02.03.2027		2.000	1.979	0,25
7,472 % fällig am 10.11.2026		1.200	1.228	0,15
NatWest Markets PLC				
1,000 % fällig am 28.05.2024	€	1.300	1.379	0,17
Nissan Motor Acceptance Co. LLC				
1,125 % fällig am 16.09.2024	$	1.400	1.305	0,16
3,875 % fällig am 21.09.2023		1.000	995	0,12
Nomura Holdings, Inc.				
1,851 % fällig am 16.07.2025		500	458	0,06
2,648 % fällig am 16.01.2025		2.800	2.652	0,33
5,386 % fällig am 06.07.2027		2.800	2.749	0,34
NongHyup Bank				
0,875 % fällig am 28.07.2024		2.500	2.370	0,30
Nordea Bank Abp				
1,125 % fällig am 16.02.2027	€	900	886	0,11
Nova Kreditna Banka Maribor d.d.				
1,875 % fällig am 27.01.2025		600	633	0,08
NTT Finance Corp.				
0,583 % fällig am 01.03.2024	$	1.200	1.160	0,15

BESCHREIBUNG		PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
4,142 % fällig am 26.07.2024	$	1.800	$ 1.772	0,22
4,239 % fällig am 25.07.2025		2.100	2.044	0,26
4,372 % fällig am 27.07.2027		300	293	0,04
Nykredit Realkredit A/S				
1,375 % fällig am 12.07.2027	€	3.000	2.922	0,37
Pacific Life Global Funding				
1,375 % fällig am 14.04.2026	$	1.700	1.520	0,19
Principal Life Global Funding				
5,471 % fällig am 23.08.2024		500	498	0,06
Protective Life Global Funding				
1,170 % fällig am 15.07.2025		1.000	906	0,11
1,646 % fällig am 13.01.2025		1.000	934	0,12
4,714 % fällig am 06.07.2027		3.300	3.209	0,40
QNB Finance Ltd.				
1,375 % fällig am 26.01.2026		300	272	0,03
Realty Income Corp.				
4,700 % fällig am 15.12.2028		1.000	970	0,12
Royal Bank of Canada				
4,125 % fällig am 05.07.2028 (a)	€	2.300	2.495	0,31
6,205 % fällig am 05.10.2023	$	600	601	0,08
Sagax AB				
2,250 % fällig am 13.03.2025	€	2.200	2.268	0,28
Sagax Euro MTN NL BV				
1,625 % fällig am 24.02.2026		1.500	1.466	0,18
Santander Holdings USA, Inc.				
6,499 % fällig am 09.03.2029	$	4.000	3.960	0,50
Santander UK Group Holdings PLC				
1,532 % fällig am 21.08.2026		1.200	1.069	0,13
6,833 % fällig am 21.11.2026		2.400	2.407	0,30
SBA Tower Trust				
1,631 % fällig am 15.05.2051		1.900	1.641	0,21
Sberbank of Russia Via SB Capital S.A.				
5,125 % fällig am 29.10.2022 ^		1.400	84	0,01
5,250 % fällig am 23.05.2023 ^(e)		500	30	0,00
Shinhan Bank Co. Ltd.				
0,250 % fällig am 16.10.2024	€	1.100	1.139	0,14
1,183 % fällig am 29.09.2025	AUD	800	484	0,06
Sirius Real Estate Ltd.				
1,125 % fällig am 22.06.2026	€	1.200	1.083	0,14
SLM Corp.				
3,125 % fällig am 02.11.2026	$	600	520	0,07
SMBC Aviation Capital Finance DAC				
3,550 % fällig am 15.04.2024		3.330	3.261	0,41
4,125 % fällig am 15.07.2023		2.290	2.288	0,29
Societe Generale S.A.				
1,488 % fällig am 14.12.2026		2.400	2.113	0,26
Standard Chartered PLC				
0,991 % fällig am 12.01.2025		1.000	970	0,12
1,214 % fällig am 23.03.2025		500	481	0,06
6,170 % fällig am 09.01.2027		300	300	0,04
Sumitomo Mitsui Banking Corp.				
0,010 % fällig am 10.09.2025	€	5.000	4.988	0,62
Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd.				
0,800 % fällig am 12.09.2023	$	700	694	0,09
Svenska Handelsbanken AB				
1,418 % fällig am 11.06.2027		300	263	0,03
Synchrony Bank				
5,400 % fällig am 22.08.2025		1.400	1.341	0,17
Synchrony Financial				
4,375 % fällig am 19.03.2024		600	588	0,07
Synovus Bank				
5,625 % fällig am 15.02.2028		500	452	0,06
Toronto-Dominion Bank				
5,440 % fällig am 10.09.2024		410	409	0,05
TP ICAP Finance PLC				
2,625 % fällig am 18.11.2028	£	600	564	0,07
Truist Bank				
2,150 % fällig am 06.12.2024	$	3.000	2.830	0,35
U.S. Bancorp				
4,653 % fällig am 01.02.2029		1.000	956	0,12
UBS AG				
5,125 % fällig am 15.05.2024 (e)		300	295	0,04
UBS Group AG				
1,494 % fällig am 10.08.2027		2.300	1.977	0,25
4,488 % fällig am 12.05.2026		3.500	3.385	0,42
6,373 % fällig am 15.07.2026		3.000	2.982	0,37
6,442 % fällig am 11.08.2028		2.235	2.245	0,28

BESCHREIBUNG		PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
UniCredit SpA				
5,850 % fällig am 15.11.2027	€	2.000	$ 2.236	0,28
7,830 % fällig am 04.12.2023	$	2.100	2.113	0,26
VICI Properties LP				
4,250 % fällig am 01.12.2026		800	749	0,09
4,500 % fällig am 01.09.2026		400	378	0,05
5,625 % fällig am 01.05.2024		700	696	0,09
Virgin Money UK PLC				
4,625 % fällig am 29.10.2028	€	900	923	0,12
Volkswagen Financial Services NV				
1,125 % fällig am 18.09.2023	£	2.700	3.399	0,43
5,500 % fällig am 07.12.2026		3.000	3.649	0,46
Vonovia SE				
1,375 % fällig am 28.01.2026	€	1.300	1.295	0,16
Wells Fargo & Co.				
4,540 % fällig am 15.08.2026	$	1.600	1.564	0,20
Weyerhaeuser Co.				
4,750 % fällig am 15.05.2026		2.200	2.162	0,27
Yango Justice International Ltd.				
5,300 % fällig am 11.01.2022 ^		200	4	0,00
			271.329	33,99
INDUSTRIEWERTE				
ABB Finance BV				
0,625 % fällig am 31.03.2024	€	2.100	2.237	0,28
Air Canada Pass-Through Trust				
3,750 % fällig am 15.06.2029	$	662	604	0,08
Amazon.com, Inc.				
0,450 % fällig am 12.05.2024		1.800	1.726	0,22
American Airlines Pass-Through Trust				
3,600 % fällig am 22.03.2029		1.688	1.572	0,20
American Medical Systems Europe BV				
0,750 % fällig am 08.03.2025	€	3.000	3.099	0,39
Amgen, Inc.				
5,250 % fällig am 02.03.2025	$	2.500	2.488	0,31
Arcadis NV				
4,875 % fällig am 28.02.2028	€	400	436	0,05
ArcelorMittal S.A.				
6,550 % fällig am 29.11.2027	$	2.000	2.053	0,26
Asahi Group Holdings Ltd.				
0,010 % fällig am 19.04.2024	€	1.200	1.267	0,16
0,155 % fällig am 23.10.2024		500	518	0,06
Ashtead Capital, Inc.				
1,500 % fällig am 12.08.2026	$	400	350	0,04
Astrazeneca Finance LLC				
4,875 % fällig am 03.03.2028		600	600	0,07
BAE Systems Holdings, Inc.				
3,850 % fällig am 15.12.2025		1.100	1.056	0,13
BAT Capital Corp.				
1,125 % fällig am 16.11.2023	€	300	324	0,04
3,222 % fällig am 15.08.2024	$	900	874	0,11
Baxter International, Inc.				
5,531 % fällig am 29.11.2024		2.389	2.369	0,30
Bayer AG				
0,050 % fällig am 12.01.2025	€	500	513	0,06
Bayer U.S. Finance LLC				
6,562 % fällig am 15.12.2023	$	1.737	1.735	0,22
BMW Canada, Inc.				
4,760 % fällig am 10.02.2025 (f)	CAD	3.500	2.616	0,33
BMW U.S. Capital LLC				
1,250 % fällig am 12.08.2026	$	500	446	0,06
Booking Holdings, Inc.				
0,100 % fällig am 08.03.2025	€	300	306	0,04
4,000 % fällig am 15.11.2026		800	875	0,11
Bureau Veritas S.A.				
1,250 % fällig am 07.09.2023		700	760	0,09
CDW LLC				
2,670 % fällig am 01.12.2026	$	1.800	1.618	0,20
4,125 % fällig am 01.05.2025		1.149	1.107	0,14
Central Japan Railway Co.				
2,200 % fällig am 02.10.2024		3.300	3.155	0,40
3,400 % fällig am 06.09.2023		300	299	0,04
CGI, Inc.				
1,450 % fällig am 14.09.2026		2.700	2.386	0,30
Chanel Ceres PLC				
0,500 % fällig am 31.07.2026	€	1.900	1.848	0,23

BESCHREIBUNG		PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
Charter Communications Operating LLC				
6,949 % fällig am 01.02.2024	$	250	$ 251	0,03
China Modern Dairy Holdings Ltd.				
2,125 % fällig am 14.07.2026		1.400	1.199	0,15
CK Hutchison International Ltd.				
4,750 % fällig am 21.04.2028		1.800	1.781	0,22
CommonSpirit Health				
2,760 % fällig am 01.10.2024		100	96	0,01
ConocoPhillips Co.				
2,400 % fällig am 07.03.2025		11	10	0,00
Continental Resources, Inc.				
2,268 % fällig am 15.11.2026		500	445	0,06
Cox Communications, Inc.				
5,450 % fällig am 15.09.2028		1.000	1.000	0,13
CPUK Finance Ltd.				
5,876 % fällig am 28.08.2027	£	1.000	1.207	0,15
CSL Finance PLC				
3,850 % fällig am 27.04.2027	$	800	764	0,10
DAE Funding LLC				
1,625 % fällig am 15.02.2024		900	868	0,11
2,625 % fällig am 20.03.2025		300	282	0,04
Daimler Truck Finance North America LLC				
5,125 % fällig am 19.01.2028		1.300	1.289	0,16
5,200 % fällig am 17.01.2025		1.100	1.092	0,14
Delta Air Lines, Inc.				
2,900 % fällig am 28.10.2024		2.100	2.018	0,25
Devon Energy Corp.				
5,250 % fällig am 15.10.2027		600	591	0,07
eBay, Inc.				
5,900 % fällig am 22.11.2025		4.000	4.045	0,51
Energy Transfer LP				
5,550 % fällig am 15.02.2028		4.000	3.993	0,50
Entergy Louisiana LLC				
0,620 % fällig am 17.11.2023		1.632	1.601	0,20
0,950 % fällig am 01.10.2024		1.400	1.320	0,17
EQM Midstream Partners LP				
4,000 % fällig am 01.08.2024		75	73	0,01
Equifax, Inc.				
5,100 % fällig am 01.06.2028		600	592	0,07
Expedia Group, Inc.				
6,250 % fällig am 01.05.2025		2.015	2.023	0,25
Flex Ltd.				
6,000 % fällig am 15.01.2028		1.700	1.728	0,22
Fraport AG Frankfurt Airport Services Worldwide				
1,625 % fällig am 09.07.2024	€	2.600	2.763	0,35
GE HealthCare Technologies, Inc.				
5,550 % fällig am 15.11.2024	$	2.400	2.389	0,30
Georgia-Pacific LLC				
0,625 % fällig am 15.05.2024		2.700	2.591	0,32
Glencore Funding LLC				
4,000 % fällig am 27.03.2027		1.500	1.431	0,18
Global Payments, Inc.				
4,950 % fällig am 15.08.2027		2.000	1.950	0,24
GN Store Nord A/S				
0,875 % fällig am 25.11.2024	€	1.500	1.527	0,19
Haleon Netherlands Capital BV				
1,250 % fällig am 29.03.2026		3.700	3.749	0,47
Haleon U.S. Capital LLC				
3,375 % fällig am 24.03.2027	$	750	702	0,09
Home Depot, Inc.				
2,875 % fällig am 15.04.2027		600	564	0,07
HPHT Finance Ltd.				
2,875 % fällig am 05.11.2024		700	673	0,08
Huntington Ingalls Industries, Inc.				
3,844 % fällig am 01.05.2025		1.200	1.155	0,14
Hyatt Hotels Corp.				
1,300 % fällig am 01.10.2023		1.700	1.685	0,21
1,800 % fällig am 01.10.2024		800	762	0,10
4,850 % fällig am 15.03.2026		300	294	0,04
Hyundai Capital America				
0,875 % fällig am 14.06.2024		1.600	1.526	0,19
1,500 % fällig am 15.06.2026		500	443	0,06
2,750 % fällig am 27.09.2026		1.900	1.729	0,22
5,800 % fällig am 26.06.2025		500	499	0,06
Illumina, Inc.				
5,800 % fällig am 12.12.2025		1.500	1.504	0,19

BESCHREIBUNG		PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
IMCD NV				
2,125 % fällig am 31.03.2027	€	2.700	$ 2.665	0,33
Imperial Brands Finance PLC				
3,500 % fällig am 26.07.2026	$	500	466	0,06
6,125 % fällig am 27.07.2027		1.595	1.599	0,20
Infor, Inc.				
1,450 % fällig am 15.07.2023		300	299	0,04
InterContinental Hotels Group PLC				
1,625 % fällig am 08.10.2024	€	800	844	0,11
3,375 % fällig am 08.10.2028	£	800	864	0,11
John Lewis PLC				
6,125 % fällig am 21.01.2025		200	245	0,03
Kenvue, Inc.				
5,500 % fällig am 22.03.2025	$	2.600	2.608	0,33
Komatsu Finance America, Inc.				
0,849 % fällig am 09.09.2023		2.350	2.328	0,29
Lenovo Group Ltd.				
5,875 % fällig am 24.04.2025		600	597	0,07
Marriott International, Inc.				
5,750 % fällig am 01.05.2025		74	74	0,01
Marvell Technology, Inc.				
2,450 % fällig am 15.04.2028		1.800	1.573	0,20
Mercedes-Benz Finance North America LLC				
4,950 % fällig am 30.03.2025		800	794	0,10
Meta Platforms, Inc.				
3,500 % fällig am 15.08.2027		1.650	1.568	0,20
Mondelez International, Inc.				
2,125 % fällig am 17.03.2024		2.300	2.244	0,28
Mundys SpA				
1,625 % fällig am 03.02.2025	€	1.300	1.356	0,17
National Fuel Gas Co.				
5,500 % fällig am 01.10.2026	$	1.000	976	0,12
Newell Brands, Inc.				
4,700 % fällig am 01.04.2026		650	611	0,08
Nissan Motor Co. Ltd.				
1,940 % fällig am 15.09.2023	€	2.000	2.173	0,27
3,043 % fällig am 15.09.2023	$	2.400	2.383	0,30
NXP BV				
5,000 % fällig am 15.01.2033		400	384	0,05
Occidental Petroleum Corp.				
6,375 % fällig am 01.09.2028		1.600	1.628	0,20
Open Text Corp.				
6,900 % fällig am 01.12.2027		3.200	3.261	0,41
Oracle Corp.				
1,650 % fällig am 25.03.2026 (f)		1.900	1.725	0,22
Ovintiv, Inc.				
5,650 % fällig am 15.05.2025		1.500	1.489	0,19
Pandora A/S				
4,500 % fällig am 10.04.2028	€	300	327	0,04
Penske Truck Leasing Co. LP				
4,125 % fällig am 01.08.2023	$	700	699	0,09
PepsiCo, Inc.				
4,450 % fällig am 15.05.2028		1.600	1.600	0,20
Pfizer Investment Enterprises Pte. Ltd.				
4,450 % fällig am 19.05.2028		900	885	0,11
Philip Morris International, Inc.				
5,125 % fällig am 15.11.2024		2.500	2.490	0,31
Pioneer Natural Resources Co.				
5,100 % fällig am 29.03.2026		1.000	994	0,12
Qorvo, Inc.				
1,750 % fällig am 15.12.2024		2.550	2.374	0,30
Regal Rexnord Corp.				
6,050 % fällig am 15.02.2026		500	501	0,06
Renesas Electronics Corp.				
1,543 % fällig am 26.11.2024		4.100	3.834	0,48
Ritchie Bros Holdings, Inc.				
6,750 % fällig am 15.03.2028		800	807	0,10
Robert Bosch GmbH				
3,625 % fällig am 02.06.2027	€	400	434	0,05
Royalty Pharma PLC				
0,750 % fällig am 02.09.2023	$	1.100	1.090	0,14
Sabine Pass Liquefaction LLC				
5,000 % fällig am 15.03.2027		568	559	0,07
5,750 % fällig am 15.05.2024		2.500	2.496	0,31

BESCHREIBUNG		PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
Sage Group PLC				
3,820 % fällig am 15.02.2028	€	1.000	$ 1.078	0,13
Sands China Ltd.				
2,800 % fällig am 08.03.2027	$	3.200	2.780	0,35
5,625 % fällig am 08.08.2025		900	879	0,11
Sealed Air Corp.				
1,573 % fällig am 15.10.2026		1.400	1.219	0,15
SEB S.A.				
1,375 % fällig am 16.06.2025	€	500	516	0,06
1,500 % fällig am 31.05.2024		200	213	0,03
Sherwin-Williams Co.				
4,250 % fällig am 08.08.2025	$	1.600	1.567	0,20
Siemens Energy Finance BV				
4,250 % fällig am 05.04.2029	€	400	425	0,05
Sika Capital BV				
3,750 % fällig am 03.11.2026		3.800	4.121	0,52
Silfin NV				
2,875 % fällig am 11.04.2027		800	785	0,10
Sixt SE				
1,750 % fällig am 09.12.2024		2.100	2.211	0,28
SK Hynix, Inc.				
1,000 % fällig am 19.01.2024	$	1.300	1.264	0,16
Sky Ltd.				
1,875 % fällig am 24.11.2023	€	2.100	2.273	0,28
Societa per Azioni Esercizi Aeroportuali SEA SpA				
3,500 % fällig am 09.10.2025		200	208	0,03
Spirit AeroSystems, Inc.				
7,500 % fällig am 15.04.2025	$	3.100	3.067	0,38
Stryker Corp.				
0,250 % fällig am 03.12.2024	€	1.000	1.035	0,13
1,125 % fällig am 30.11.2023		2.500	2.696	0,34
Studio City Co. Ltd.				
7,000 % fällig am 15.02.2027	$	2.800	2.626	0,33
Studio City Finance Ltd.				
6,000 % fällig am 15.07.2025		600	558	0,07
Suntory Holdings Ltd.				
2,250 % fällig am 16.10.2024		1.100	1.045	0,13
Swedish Match AB				
0,875 % fällig am 23.09.2024	€	500	522	0,07
Syngenta Finance NV				
3,375 % fällig am 16.04.2026		800	838	0,10
4,892 % fällig am 24.04.2025	$	400	392	0,05
T-Mobile USA, Inc.				
2,250 % fällig am 15.02.2026		1.100	1.012	0,13
3,500 % fällig am 15.04.2025		450	433	0,05
4,800 % fällig am 15.07.2028		1.800	1.764	0,22
4,950 % fällig am 15.03.2028		500	492	0,06
Take-Two Interactive Software, Inc.				
3,300 % fällig am 28.03.2024		35	34	0,00
Targa Resources Corp.				
5,200 % fällig am 01.07.2027		2.500	2.456	0,31
TD SYNNEX Corp.				
1,250 % fällig am 09.08.2024		2.000	1.892	0,24
1,750 % fällig am 09.08.2026		900	785	0,10
Tennessee Gas Pipeline Co. LLC				
7,000 % fällig am 15.10.2028		1.396	1.475	0,18
TenneT Holding BV				
3,875 % fällig am 28.10.2028	€	600	663	0,08
Tesco Corporate Treasury Services PLC				
1,375 % fällig am 24.10.2023		250	271	0,03
Texas Instruments, Inc.				
4,600 % fällig am 15.02.2028	$	1.000	1.002	0,13
Thermo Fisher Scientific Finance BV				
3,582 % fällig am 18.11.2023	€	3.700	4.036	0,51
TransDigm, Inc.				
6,750 % fällig am 15.08.2028	$	1.300	1.307	0,16
Transurban Finance Co. Pty. Ltd.				
4,125 % fällig am 02.02.2026		1.900	1.829	0,23
Ubisoft Entertainment S.A.				
0,878 % fällig am 24.11.2027	€	700	587	0,07
Union Pacific Corp.				
4,750 % fällig am 21.02.2026	$	1.800	1.789	0,22
United Airlines Pass-Through Trust				
4,300 % fällig am 15.02.2027		520	501	0,06
United Airlines, Inc.				
4,375 % fällig am 15.04.2026		1.400	1.331	0,17

BESCHREIBUNG		PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
Var Energi ASA				
7,500 % fällig am 15.01.2028	$	1.700	$ 1.750	0,22
VMware, Inc.				
0,600 % fällig am 15.08.2023		2.000	1.988	0,25
4,500 % fällig am 15.05.2025		1.600	1.568	0,20
Volkswagen Group of America Finance LLC				
4,350 % fällig am 08.06.2027		800	771	0,10
6,040 % fällig am 07.06.2024		3.000	3.007	0,38
Warnermedia Holdings, Inc.				
3,755 % fällig am 15.03.2027		1.200	1.120	0,14
Weir Group PLC				
2,200 % fällig am 13.05.2026		4.700	4.212	0,53
6,875 % fällig am 14.06.2028	£	400	502	0,06
Werfen S.A.				
4,625 % fällig am 06.06.2028	€	900	970	0,12
West Fraser Timber Co. Ltd.				
4,350 % fällig am 15.10.2024	$	200	195	0,02
Westinghouse Air Brake Technologies Corp.				
3,200 % fällig am 15.06.2025		562	534	0,07
Williams Cos., Inc.				
5,400 % fällig am 02.03.2026		1.000	998	0,12
Woodside Finance Ltd.				
3,650 % fällig am 05.03.2025		600	578	0,07
Worley Financial Services Pty. Ltd.				
5,950 % fällig am 13.10.2028	AUD	2.600	1.674	0,21
Wynn Macau Ltd.				
4,875 % fällig am 01.10.2024	$	2.100	2.050	0,26
Zimmer Biomet Holdings, Inc.				
3,550 % fällig am 01.04.2025		1.600	1.542	0,19
Zoetis, Inc.				
5,400 % fällig am 14.11.2025		1.700	1.706	0,21
			230.427	28,87
VERSORGUNGSUNTERNEHMEN				
AES Corp.				
5,450 % fällig am 01.06.2028		600	590	0,07
Ameren Illinois Co.				
3,800 % fällig am 15.05.2028		1.000	953	0,12
Appalachian Power Co.				
3,300 % fällig am 01.06.2027		600	561	0,07
Avangrid, Inc.				
3,150 % fällig am 01.12.2024		500	480	0,06
Black Hills Corp.				
5,950 % fällig am 15.03.2028		3.000	3.037	0,38
Constellation Energy Generation LLC				
5,600 % fällig am 01.03.2028		700	706	0,09
DTE Electric Co.				
1,900 % fällig am 01.04.2028		1.000	876	0,11
Duke Energy Corp.				
4,300 % fällig am 15.03.2028		1.000	961	0,12
5,000 % fällig am 08.12.2025		3.800	3.775	0,47
East Ohio Gas Co.				
1,300 % fällig am 15.06.2025		1.800	1.651	0,21
EnBW International Finance BV				
3,625 % fällig am 22.11.2026	€	2.000	2.170	0,27
Enel Finance America LLC				
7,100 % fällig am 14.10.2027	$	200	210	0,03
Enel Finance International NV				
0,000 % fällig am 17.06.2024 (c)	€	800	840	0,11
1,375 % fällig am 12.07.2026	$	1.000	883	0,11
2,650 % fällig am 10.09.2024		4.200	4.043	0,51
4,250 % fällig am 15.06.2025		1.700	1.651	0,21
EP Infrastructure A/S				
1,659 % fällig am 26.04.2024	€	600	624	0,08
Evergy Missouri West, Inc.				
5,150 % fällig am 15.12.2027	$	2.000	1.975	0,25
Eversource Energy				
5,339 % fällig am 15.08.2023		700	700	0,09
5,450 % fällig am 01.03.2028		1.200	1.209	0,15
Florida Power & Light Co.				
5,050 % fällig am 01.04.2028		700	706	0,09
Georgia Power Co.				
2,100 % fällig am 30.07.2023		200	199	0,02
India Green Energy Holdings				
5,375 % fällig am 29.04.2024		250	244	0,03

BESCHREIBUNG		PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
Ipalco Enterprises, Inc.				
3,700 % fällig am 01.09.2024	$	1.348	$ 1.304	0,16
ITC Holdings Corp.				
4,950 % fällig am 22.09.2027		850	837	0,11
Jersey Central Power & Light Co.				
4,700 % fällig am 01.04.2024		1.083	1.072	0,13
KeySpan Gas East Corp.				
2,742 % fällig am 15.08.2026		1.600	1.454	0,18
Lorca Telecom Bondco S.A.				
4,000 % fällig am 18.09.2027	€	600	599	0,08
Midwest Connector Capital Co. LLC				
3,900 % fällig am 01.04.2024	$	200	196	0,02
Mississippi Power Co.				
3,950 % fällig am 30.03.2028		2.495	2.349	0,29
5,392 % fällig am 28.06.2024		3.090	3.069	0,38
National Rural Utilities Cooperative Finance Corp.				
5,362 % fällig am 18.10.2024		975	968	0,12
NextEra Energy Capital Holdings, Inc.				
2,200 % fällig am 02.12.2026	AUD	2.500	1.503	0,19
5,481 % fällig am 03.11.2023	$	2.900	2.900	0,36
6,112 % fällig am 21.03.2024		500	500	0,06
ONEOK, Inc.				
4,550 % fällig am 15.07.2028		1.600	1.518	0,19
Pacific Gas & Electric Co.				
3,300 % fällig am 15.03.2027 ^		300	272	0,03
3,400 % fällig am 15.08.2024 ^		100	97	0,01
3,450 % fällig am 01.07.2025		100	94	0,01
3,500 % fällig am 15.06.2025 ^		1.700	1.610	0,20
3,750 % fällig am 15.02.2024 ^		200	197	0,02
3,850 % fällig am 15.11.2023 ^		200	198	0,02
4,250 % fällig am 01.08.2023		2.400	2.398	0,30
4,950 % fällig am 08.06.2025		2.000	1.940	0,24
Pennsylvania Electric Co.				
4,150 % fällig am 15.04.2025		1.950	1.877	0,24
Potomac Electric Power Co.				
3,600 % fällig am 15.03.2024		1.262	1.244	0,16
San Diego Gas & Electric Co.				
2,500 % fällig am 15.05.2026		226	211	0,03
Sempra Energy				
3,300 % fällig am 01.04.2025		3.100	2.975	0,37
Southern California Edison Co.				
0,975 % fällig am 01.08.2024		800	760	0,10
4,200 % fällig am 01.06.2025		3.200	3.122	0,39
5,300 % fällig am 01.03.2028		1.500	1.501	0,19
5,850 % fällig am 01.11.2027		100	102	0,01
5,922 % fällig am 01.04.2024		557	556	0,07
Southern Power Co.				
0,900 % fällig am 15.01.2026		3.000	2.690	0,34
Sprint LLC				
7,125 % fällig am 15.06.2024		125	126	0,02
7,875 % fällig am 15.09.2023		1.100	1.104	0,14
State Grid Overseas Investment BVI Ltd.				
0,797 % fällig am 05.08.2026	€	500	495	0,06
System Energy Resources, Inc.				
2,140 % fällig am 09.12.2025	$	1.150	1.044	0,13
Tampa Electric Co.				
3,875 % fällig am 12.07.2024		800	786	0,10
Trans-Allegheny Interstate Line Co.				
3,850 % fällig am 01.06.2025		1.305	1.255	0,16
Verizon Communications, Inc.				
5,882 % fällig am 20.03.2026		800	801	0,10
Vistra Operations Co. LLC				
3,550 % fällig am 15.07.2024		3.325	3.212	0,40
WEC Energy Group, Inc.				
4,750 % fällig am 09.01.2026		1.500	1.478	0,19
			79.458	9,95
Summe Unternehmensanleihen und Wechsel			581.214	72,81
KOMMUNALANLEIHEN UND WECHSEL				
State Board of Administration Finance Corp., Florida Revenue Notes, Series 2020				
1,258 % fällig am 01.07.2025		1.200	1.109	0,14
US-REGIERUNGSBEHÖRDEN				
Ginnie Mae, TBA				
2,500 % fällig am 01.08.2053		2.700	2.340	0,29
Uniform Mortgage-Backed Security, TBA				
3,500 % fällig am 01.08.2053	$	8.900	$ 8.120	1,02
4,000 % fällig am 01.08.2053		27.100	25.456	3,19
4,500 % fällig am 01.07.2053		5.200	5.000	0,63
5,000 % fällig am 01.09.2053		4.300	4.216	0,53
			45.132	5,66
US-SCHATZOBLIGATIONEN				
U.S. Treasury Notes				
1,500 % fällig am 30.11.2024		800	760	0,09
3,500 % fällig am 15.09.2025		6.700	6.520	0,82
3,875 % fällig am 31.03.2025		16.500	16.177	2,03
4,000 % fällig am 15.12.2025		6.100	6.006	0,75
4,125 % fällig am 31.01.2025		41.600	40.953	5,13
4,250 % fällig am 15.10.2025		20.900	20.670	2,59
4,375 % fällig am 31.10.2024		23.100	22.825	2,86
4,500 % fällig am 15.11.2025		5.100	5.074	0,64
			118.985	14,91
NON-AGENCY-MBS				
GSR Mortgage Loan Trust				
4,070 % fällig am 25.09.2035		2	2	0,00
Morgan Stanley Mortgage Loan Trust				
5,190 % fällig am 25.11.2034		:	2	0,00
6,297 % fällig am 25.09.2034		278	276	0,03
WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust				
4,470 % fällig am 25.01.2033		4	3	0,00
5,226 % fällig am 25.01.2047		165	149	0,02
			432	0,05
FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE				
Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust				
5,770 % fällig am 25.12.2035		307	294	0,04
OCP Euro CLO DAC				
4,713 % fällig am 20.01.2033	€	1.000	1.089	0,13
			1.383	0,17
STAATSEMISSIONEN				
Canada Government International Bond				
1,500 % fällig am 01.09.2024	CAD	2.800	2.036	0,26
Cassa Depositi e Prestiti SpA				
5,750 % fällig am 05.05.2026	$	2.000	1.975	0,25
France Government International Bond				
0,000 % fällig am 25.03.2025 (c)	€	9.000	9.279	1,16
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro				
0,000 % fällig am 01.04.2026 (c)		2.700	2.659	0,33
Bundesrepublik Deutschland				
2,500 % fällig am 13.03.2025		6.700	7.220	0,90
South Africa Government International Bond				
10,500 % fällig am 21.12.2026	ZAR	139.500	7.669	0,96
United Kingdom Gilt				
1,625 % fällig am 22.10.2028	£	7.200	7.861	0,99
			38.699	4,85
		AKTIEN		
STAMMAKTIEN				
FINANZWERTE				
Stearns Holdings LLC 'B' (b)		43.861	0	0,00
OPTIONSSCHEINE				
Guaranteed Rate, Inc. - Exp. 31.12.2060		211	0	0,00
		PAR (000S)		
KURZFRISTIGE INSTRUMENTE				
COMMERCIAL PAPER				
American Electric Power Co., Inc.				
5,480 % fällig am 01.08.2023	$	2.000	1.990	0,25
5,480 % fällig am 14.08.2023		1.300	1.291	0,16
AT+T, Inc.				
5,700 % fällig am 19.03.2024		4.700	4.499	0,56
Becton Dickinson and Co.				
5,390 % fällig am 10.07.2023	$	700	$ 699	0,09
Constellation Brands, Inc.				
5,580 % fällig am 17.07.2023		250	249	0,03
5,580 % fällig am 18.07.2023		850	848	0,11
5,610 % fällig am 11.07.2023		300	299	0,04
Crown Castle, Inc.				
5,870 % fällig am 20.07.2023		600	598	0,08
Dominion Resources, Inc.				
5,400 % fällig am 19.07.2023		300	299	0,04
5,410 % fällig am 11.07.2023		250	250	0,03
Electricite de France S.A.				
5,570 % fällig am 14.07.2023		3.700	3.692	0,46
Enbridge, Inc.				
5,400 % fällig am 12.07.2023		2.300	2.296	0,29
5,480 % fällig am 17.07.2023		1.000	997	0,13
J.M. Smucker Co.				
5,410 % fällig am 17.07.2023		5.300	5.287	0,66
L3Harris Technologies, Inc.				
5,530 % fällig am 17.07.2023		2.900	2.893	0,36
Leidos, Inc.				
5,900 % fällig am 10.07.2023		400	399	0,05
Parker Hannifin Corp.				
5,400 % fällig am 18.07.2023		900	898	0,11
5,400 % fällig am 19.07.2023		900	898	0,11
5,400 % fällig am 20.07.2023		900	897	0,11
5,400 % fällig am 21.07.2023		700	698	0,09
Penske Truck Leasing Co. LP				
5,350 % fällig am 11.07.2023		1.500	1.498	0,19
Thomson Reuters Corp.				
5,470 % fällig am 18.07.2023		1.200	1.197	0,15
			32.672	4,10
KURZFRISTIGE SCHULDTITEL				
HF Sinclair Corp.				
2,625 % fällig am 01.10.2023		1.300	1.289	0,16
Summe kurzfristige Instrumente			33.961	4,26
Summe Übertragbare Wertpapiere			**$ 821.335**	**102,90**
		AKTIEN		
INVESTMENTFONDS				
ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN				
PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (d)		627.529	6.249	0,78
PIMCO Specialty Funds Ireland p.l.c. - PIMCO China Bond Fund (d)		5.163	67	0,01
Summe Investmentfonds			**$ 6.316**	**0,79**

PENSIONSGESCHÄFTE

Kontrahent	Kredit-zins	Abrechnungs-datum	Fälligkeits-datum	Kapital-betrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensions-geschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensions-geschäft[1]	% des Nettovermögens
FICC	2,400 %	30.06.2023	03.07.2023	$ 563	U.S. Treasury Notes 4,625 % fällig am 30.06.2025	$ (574)	$ 563	$ 563	0,07
Summe Pensionsgeschäfte						**$ (574)**	**$ 563**	**$ 563**	**0,07**

(1) Umfasst aufgelaufene Zinsen.

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

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

FUTURES

Beschreibung	Art	Ablauf-monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
3-Month SOFR December Futures	Short	03.2024	16	$ 37	0,00
Euro-Bobl September Futures	Long	09.2023	109	(187)	(0,02)
U.S. Treasury 5-Year Note September Futures	Long	09.2023	270	(537)	(0,07)
U.S. Treasury 10-Year Ultra September Futures	Short	09.2023	106	138	0,02
				$ (549)	(0,07)
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate				**$ (549)**	**(0,07)**

ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)

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

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMMISSIONEN - SCHUTZVERKAUF[1]

Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag[2]	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
AT&T, Inc.	1,000 %	20.12.2024	$ 1.300	$ (12)	0,00
AT&T, Inc.	1,000	20.12.2025	200	(2)	0,00
Barclays Bank PLC	1,000	20.12.2023	€ 500	0	0,00
Boeing Co.	1,000	20.12.2023	$ 800	7	0,00
Boeing Co.	1,000	20.12.2024	1.500	47	0,01
Boeing Co.	1,000	20.12.2026	1.300	12	0,00
Boeing Co.	1,000	20.06.2027	1.200	75	0,01
General Electric Co.	1,000	20.06.2026	3.700	(8)	0,00
General Electric Co.	1,000	20.12.2026	400	0	0,00
General Motors Co.	5,000	20.12.2026	80	(5)	0,00
General Motors Co.	5,000	20.06.2028	95	2	0,00
Glencore Finance Europe Ltd.	5,000	20.06.2028	€ 500	2	0,00
International Lease Finance Corp.	5,000	20.12.2023	$ 900	(61)	(0,01)
NextEra Energy Capital Holdings, Inc.	1,000	20.06.2026	300	(4)	0,00
Rolls-Royce PLC	1,000	20.12.2024	€ 2.200	4	0,00
Rolls-Royce PLC	1,000	20.12.2025	500	3	0,00
Ryder System, Inc.	1,000	20.12.2023	$ 1.100	(8)	0,00
Verizon Communications, Inc.	1,000	20.12.2027	200	3	0,00
Verizon Communications, Inc.	1,000	20.06.2028	2.300	7	0,00
Vodafone Group PLC	1,000	20.06.2024	€ 1.200	(12)	0,00
				$ 50	0,01

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES - SCHUTZVERKAUF[1]

Index/Tranchen	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag[2]	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
CDX.IG-39 5-Year Index	1,000 %	20.12.2027	$ 4.900	$ 22	0,00
CDX.IG-40 5-Year Index	1,000	20.06.2028	30.800	212	0,03
iTraxx Crossover 39 5-Year Index	5,000	20.06.2028	€ 500	17	0,00
iTraxx Europe Main 39 5-Year Index	1,000	20.06.2028	13.600	36	0,00
				$ 287	0,03

ZINSSWAPS

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,399 %	18.06.2028	¥ 77.700	$ 10	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,750	15.06.2027	$ 9.400	(426)	(0,05)
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	2,000	14.11.2023	CAD 14.700	(156)	(0,02)
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	2,050	16.11.2023	7.800	(85)	(0,01)
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	2,070	22.11.2023	11.900	(129)	(0,02)
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	2,250	15.06.2024	24.700	(183)	(0,02)

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Erhalt	3-Month ZAR-JIBAR	7,300 %	28.04.2027	ZAR 68.300	$ 147	0,02
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	0,550	10.08.2024	€ 1.700	(76)	(0,01)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	0,650	11.05.2027	4.400	(459)	(0,06)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	1,000	13.05.2027	3.200	(300)	(0,04)
Zahlung[3]	6-Month EUR-EURIBOR	3,000	20.09.2028	35.100	(67)	(0,01)
Zahlung[3]	6-Month EUR-EURIBOR	3,500	20.09.2025	15.800	7	0,00
Zahlung	6-Month HUF-BBR	1,250	19.09.2023	HUF 1.604.100	(23)	0,00
					$ (1.740)	(0,22)
Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate					**$ (1.403)**	**(0,18)**

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

(2) Der maximal mögliche Betrag, den der Fonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

(3) Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft.

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

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

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMMISSIONEN - SCHUTZVERKAUF[1]

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag[2]	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Markt-wert	% des Nettovermögens
BOA	Brazil Government International Bond	1,000 %	20.06.2026	$ 100	$ (3)	$ 3	$ 0	0,00
JPM	Banco do Brasil S.A.	1,000	20.12.2024	700	(16)	11	(5)	0,00
					$ (19)	$ 14	$ (5)	0,00

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

(2) Der maximal mögliche Betrag, den der Fonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
AZD	07.2023	$ 85	AUD 128	$ 0	$ 0	$ 0	0,00
	08.2023	AUD 128	$ 85	0	0	0	0,00
BOA	07.2023	£ 370	465	0	(5)	(5)	0,00
	07.2023	$ 4.409	¥ 636.145	2	0	2	0,00
	09.2023	606	IDR 9.070.817	0	(3)	(3)	0,00
BPS	07.2023	AUD 198	$ 129	0	(3)	(3)	0,00
	07.2023	€ 152.870	164.336	0	(2.446)	(2.446)	(0,31)
	07.2023	$ 60	AUD 91	0	0	0	0,00
	07.2023	172.041	€ 157.037	0	(715)	(715)	(0,09)
	07.2023	3.583	¥ 498.029	0	(137)	(137)	(0,02)
	07.2023	651	MXN 11.631	27	0	27	0,00
	08.2023	AUD 91	$ 61	0	0	0	0,00
	08.2023	€ 150.325	164.942	714	0	714	0,09
	09.2023	$ 102	IDR 1.536.140	0	0	0	0,00
	10.2023	ZAR 69.220	$ 3.729	104	0	104	0,01
	12.2023	$ 226	MXN 4.038	2	0	2	0,00
BRC	08.2023	838	COP 3.571.258	6	0	6	0,00
	09.2023	IDR 10.084	$ 1	0	0	0	0,00
	09.2023	$ 280	IDR 4.197.133	0	(1)	(1)	0,00
CBK	07.2023	CAD 6.311	$ 4.631	0	(138)	(138)	(0,02)
	07.2023	€ 1.580	1.695	0	(28)	(28)	0,00
	07.2023	$ 651	MXN 11.631	27	0	27	0,00
	08.2023	529	NOK 5.518	0	(13)	(13)	0,00
DUB	07.2023	£ 6.316	$ 7.875	0	(155)	(155)	(0,02)
	07.2023	$ 803	BRL 4.348	100	0	100	0,01
GLM	07.2023	BRL 4.362	$ 903	0	(1)	(1)	0,00
	08.2023	$ 22	CHF 19	0	0	0	0,00
	08.2023	661	NOK 7.015	0	(5)	(5)	0,00
	08.2023	ZAR 71.904	$ 3.874	83	0	83	0,01
	09.2023	$ 903	BRL 4.410	1	0	1	0,00
	09.2023	2.516	MXN 43.978	11	0	11	0,00
JPM	07.2023	¥ 169.602	$ 1.186	13	0	13	0,00
	08.2023	$ 33	CHF 29	0	0	0	0,00

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung		Zu erhaltende Währung		Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
	08.2023	$	5.344	¥	742.124	$ 0	$ (179)	$ (179)	(0.02)
	08.2023		244	NOK	2.587	0	(2)	(2)	0,00
	08.2023		401	ZAR	7.335	0	(14)	(14)	0,00
	09.2023		253	IDR	3.803.628	0	0	0	0,00
	09.2023		1.288	INR	106.133	2	0	2	0,00
MBC	07.2023	€	926	$	992	0	(19)	(19)	0,00
	07.2023	£	17.353		21.481	0	(582)	(582)	(0,07)
MYI	07.2023		19		24	0	0	0	0,00
	07.2023	IDR	2.391.180		160	0	0	0	0,00
	07.2023	$	1.631	€	1.502	8	0	8	0,00
	07.2023		2.532	£	2.037	57	0	57	0,01
	07.2023		159	IDR	2.391.180	0	0	0	0,00
	09.2023		391		5.840.410	0	(3)	(3)	0,00
	09.2023		278	INR	22.924	1	0	1	0,00
RBC	07.2023	MXN	3.315	$	172	0	(21)	(21)	0,00
SCX	07.2023	$	125	AUD	188	0	0	0	0,00
	08.2023	AUD	188	$	125	0	0	0	0,00
	09.2023	$	720	IDR	10.713.840	0	(8)	(8)	0,00
	09.2023		806	INR	66.378	1	0	1	0,00
TOR	07.2023	AUD	422	$	276	0	(5)	(5)	0,00
	07.2023	$	152	AUD	231	1	0	1	0,00
	07.2023		4.770	CAD	6.311	3	(3)	0	0,00
	07.2023		28.012	£	22.045	14	0	14	0,00
	08.2023	AUD	231	$	153	0	(1)	(1)	0,00
	08.2023	CAD	6.309		4.770	3	(3)	0	0,00
	08.2023	£	22.045		28.018	0	(14)	(14)	0,00
	08.2023	HUF	148.436		424	0	(5)	(5)	0,00
UAG	07.2023	AUD	143		94	0	(2)	(2)	0,00
	07.2023	$	74	AUD	111	0	0	0	0,00
	08.2023	AUD	111	$	74	0	0	0	0,00
						$ 1.180	$ (4.511)	$ (3.331)	(0,42)

ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklassen Institutional EUR (Hedged) thesaurierend, Institutional EUR (Hedged) ausschüttend und Class E EUR (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung		Zu erhaltende Währung		Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2023	€	1.943	$	2.124	$ 4	$ 0	$ 4	0,00
	07.2023	$	164.009	€	152.608	2.486	0	2.486	0,31
BPS	07.2023	€	154.056	$	168.798	722	0	722	0,09
	07.2023	$	164.765	€	153.248	2.437	(8)	2.429	0,31
	08.2023		168.473		153.543	0	(729)	(729)	(0,09)
CBK	07.2023	€	155.370	$	168.886	0	(622)	(622)	(0,08)
	07.2023	$	3.667	€	3.352	0	(10)	(10)	0,00
	08.2023		166.366		152.807	575	0	575	0,07
JPM	07.2023	€	152.807	$	166.850	137	0	137	0,02
	07.2023	$	164.409	€	153.772	3.357	0	3.357	0,42
	08.2023		167.083		152.807	0	(143)	(143)	(0,02)
MBC	07.2023	€	812	$	888	4	(2)	2	0,00
	07.2023	$	118	€	109	1	0	1	0,00
SCX	07.2023		2.956		2.762	58	0	58	0,01
						$ 9.781	$ (1.514)	$ 8.267	1,04

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklassen Institutional GBP (Hedged) thesaurierend und Institutional GBP (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung		Zu erhaltende Währung		Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2023	£	23	$	29	$ 0	$ 0	$ 0	0,00
	07.2023	$	67	£	53	1	0	1	0,00
BPS	07.2023		9.723		7.861	271	0	271	0,03
BRC	07.2023	£	13	$	16	0	0	0	0,00
	07.2023	$	40	£	32	0	0	0	0,00
CBK	07.2023	£	89	$	113	0	0	0	0,00
	07.2023	$	27	£	22	0	0	0	0,00
JPM	07.2023	£	7.803	$	9.867	0	(54)	(54)	(0,01)
	08.2023	$	9.869	£	7.803	54	0	54	0,01
MBC	07.2023	£	3	$	4	0	0	0	0,00
	07.2023	$	9.716	£	7.849	262	0	262	0,03
MYI	07.2023		9.695		7.800	222	0	222	0,03
RYL	07.2023		19		15	0	0	0	0,00
TOR	07.2023	£	7.825	$	9.943	0	(5)	(5)	0,00
	08.2023	$	9.945	£	7.825	5	0	5	0,00
						$ 815	$ (59)	$ 756	0,09

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklasse Institutional NOK (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung		Zu erhaltende Währung		Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2023	$	10.024	NOK	111.442	$ 378	$ 0	$ 378	0,05
CBK	07.2023	NOK	511	$	46	0	(2)	(2)	0,00
	07.2023	$	4.982	NOK	56.024	247	0	247	0,03
GLM	07.2023	NOK	46.057	$	4.273	0	(26)	(26)	0,00
	07.2023	$	26	NOK	283	0	0	0	0,00
	08.2023		4.273		46.012	26	0	26	0,00
						$ 651	$ (28)	$ 623	0,08

Summe Freiverkehrsfinanzderivate	**$ 6.310**	**0,79**
Summe Anlagen	**$ 832.572**	**104,30**
Sonstige Aktiva und Passiva	**$ (34.355)**	**(4,30)**
Nettovermögen	**$ 798.217**	**100,00**

ERLÄUTERUNGEN ZUR AUFSTELLUNG DES WERTPAPIERBESTANDS (Angaben in Tausend*):

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

^ **Das Wertpapier ist in Verzug.**

(a) **Wertpapier per Emissionstermin.**

(b) **Das Wertpapier hat in den letzten zwölf Monaten keine Erträge geliefert.**

(c) **Nullkuponwertpapier.**

(d) **Mit dem Fonds verbunden.**

(e) **Bedingt wandelbares Wertpapier.**

(f) **Eingeschränkte Wertpapiere (31. Dezember 2022: 1,31 %):**

Emittentenbeschreibung	Kupon	Fälligkeits-datum	Kauf-datum	Kosten	Markt-wert	% des Nettovermögens
BMW Canada, Inc.	4,760 %	10.02.2025	07.02.2023	$ 2.601	$ 2.616	0,33
Citigroup, Inc.	2,014	25.01.2026	18.01.2022	2.000	1.880	0,24
Citigroup, Inc.	3,290	17.03.2026	10.03.2022	3.200	3.062	0,38
Deutsche Bank AG	1,447	01.04.2025	30.03.2021	1.600	1.521	0,19
Deutsche Bank AG	2,129	24.11.2026	17.11.2020	500	445	0,06
Oracle Corp.	1,650	25.03.2026	22.03.2021	1.899	1.725	0,22
				$ 11.800	$ 11.249	1,42

Wertpapiere mit einem gesamten beizulegenden Zeitwert von null USD (31. Dezember 2022: 12.682 USD) wurden zum 30. Juni 2023 gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte als Sicherheit verpfändet.

Wertpapiere mit einem gesamten beizulegenden Zeitwert von null USD (31. Dezember 2022: 1.396 USD) wurden zum 30. Juni 2023 gemäß den Rahmenverträgen für Wertpapier-Termingeschäfte für verzögert gelieferte Wertpapiere oder Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte als Sicherheit verpfändet oder geliefert.

Barmittel in Höhe von 9.374 USD (31. Dezember 2022: 9.433 USD) wurden zum 30. Juni 2023 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Barmittel in Höhe von 310 USD (31. Dezember 2022: 426 USD) wurden zum 30. Juni 2023 gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. als Sicherheit für Finanzderivate verpfändet.

Beizulegender Zeitwert[1]

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 30. Juni 2023 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie[2]	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	$ 0	$ 821.219	$ 116	$ 821.335
Investmentfonds	6.316	0	0	6.316
Pensionsgeschäfte	0	563	0	563
Finanzderivate[3]	(187)	4.545	0	4.358
Summen	**$ 6.129**	**$ 826.327**	**$ 116**	**$ 832.572**

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

Kategorie[2]	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	$ 0	$ 691.422	$ 0	$ 691.422
Investmentfonds	643	0	0	643
Pensionsgeschäfte	0	1.604	0	1.604
Finanzderivate[3]	(614)	2.737	0	2.123
Leerverkaufte Wertpapiere	0	(14.029)	0	(14.029)
Summen	**$ 29**	**$ 681.734**	**$ 0**	**$ 681.763**

(1) Weitere Informationen finden Sie in den Erläuterungen in Erläuterung 3.

(2) Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung des Wertpapierbestands.

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

Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC-Finanzderivate und -Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2023 und 31. Dezember 2022:

	Zum 30. Jun. 2023			Zum 31. Dez. 2022		
Kontrahent	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-engagement[1]	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-engagement[1]
BOA	$ 2.863	$ (2.200)	$ 663	$ (35)	$ 0	$ (35)
BPS	239	(310)	(71)	(202)	140	(62)
BRC	5	0	5	146	(120)	26
CBK	36	0	36	4.468	(4.360)	108
DUB	(55)	0	(55)	k. A.	k. A.	k. A.
GLM	89	0	89	(12)	16	4
JPM	3.166	(2.550)	616	84	0	84
MBC	(336)	310	(26)	170	(290)	(120)
MYI	285	(320)	(35)	(74)	0	(74)
RBC	(21)	0	(21)	13	0	13
SCX	51	0	51	4.065	(3.850)	215
TOR	(10)	0	(10)	6	(20)	(14)
UAG	(2)	0	(2)	(199)	270	71

(1) Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären.

Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung des Wertpapierbestands zum 30. Juni 2023:

	30. Jun. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	71,89	73,17
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	31,01	32,43
Investmentfonds	0,79	0,10
Pensionsgeschäfte	0,07	0,24
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	(0,07)	0,05
Zentral abgerechnete Finanzderivate	(0,18)	(1,02)
Freiverkehrsfinanzderivate	0,79	1,30
Leerverkaufte Wertpapiere	k. A.	(2,14)
Umgekehrte Pensionsgeschäfte	k. A.	(1,95)
Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte	k. A.	(0,22)

Das Anlageportfolio des Fonds konzentriert sich zum 30. Juni 2023 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	30. Jun. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
Kreditbeteiligungen und -abtretung	0,05	0,55
Unternehmensanleihen und Wechsel	72,81	83,16
Kommunalanleihen und Wechsel	0,14	0,17
US-Regierungsbehörden	5,66	6,33
US-Schatzobligationen	14,91	10,55
Non-Agency-MBS	0,05	0,07
Forderungsbesicherte Wertpapiere	0,17	0,22
Staatsemissionen	4,85	3,40
Stammaktien	0,00	0,00
Optionsscheine	0,00	0,00
Kurzfristige Instrumente	4,26	1,15
Investmentfonds	0,79	0,10
Pensionsgeschäfte	0,07	0,24
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	(0,07)	0,05
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen - Schutzkauf	k. A.	0,00
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	0,01	(0,03)
Credit Default Swaps auf Kreditindizes— Schutzverkauf	0,03	0,01
Zinsswaps	(0,22)	(1,00)
Freiverkehrsfinanzderivate		
Verkaufsoptionen		
Credit Default Swaptions auf Kreditindizes	k. A.	0,00
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	0,00	0,01
Devisenterminkontrakte	(0,42)	(0,48)
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	1,21	1,77
Leerverkaufte Wertpapiere	k. A.	(2,14)
Sonstige Aktiva und Passiva	(4,30)	(4,13)
Nettovermögen	100,00	100,00

Aufstellung des Wertpapierbestands des Low Duration Income Fund

BESCHREIBUNG		PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE				
KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG				
American Airlines, Inc.				
10,000 % fällig am 20.04.2028	$	900	$ 920	0,06
Carnival Corp.				
7,168 % fällig am 30.06.2025	€	3.386	3.685	0,25
Clear Channel Outdoor Holdings, Inc.				
8,584 % - 8,807 % fällig am 21.08.2026	$	0	0	0,00
Emerald TopCo, Inc.				
8,584 % fällig am 24.07.2026		72	71	0,01
Envision Healthcare Corp.				
16,070 % fällig am 29.04.2027		677	807	0,06
16,695 % fällig am 28.04.2028 ^		1.648	1.214	0,08
iHeartCommunications, Inc.				
8,217 % fällig am 01.05.2026		6.168	5.358	0,37
8,469 % fällig am 01.05.2026		1.584	1.379	0,10
Intelsat Jackson Holdings S.A.				
9,443 % fällig am 01.02.2029		814	812	0,06
Lealand Finance Co. BV				
8,193 % fällig am 28.06.2024		8	7	0,00
Lealand Finance Co. BV (2,666 % bar oder 3,000 % PIK)				
3,000 % - 6,193 % fällig am 30.06.2025 (c)		24	14	0,00
Poseidon BidCo S.A.S				
8,848 % fällig am 14.07.2028	€	4.000	4.277	0,29
PUG LLC				
8,525 % fällig am 12.02.2027	$	29	26	0,00
Syniverse Holdings, Inc.				
12,242 % fällig am 13.05.2027		58	53	0,00
TransDigm, Inc.				
TBD % fällig am 30.05.2025		0	0	0,00
TBD % fällig am 09.12.2025		0	0	0,00
8,492 % fällig am 24.08.2028		12.047	12.054	0,83
U.S. Renal Care, Inc.				
10,192 % fällig am 26.06.2026		293	138	0,01
Westmoreland Coal Co. (15,000 % PIK)				
TBD % fällig am 15.03.2029 (c)		13	9	0,00
Windstream Services LLC				
11,452 % fällig am 21.09.2027		3	3	0,00
Wm Morrison Supermarkets Ltd.				
8,073 % fällig am 04.11.2027	€	2.374	2.229	0,15
			33.056	2,27
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
BANKEN UND FINANZEN				
Adler Financing SARL				
12,500 % fällig am 30.06.2025		5.771	6.463	0,44
AGPS BondCo PLC				
5,000 % fällig am 27.04.2027 ^		8.300	3.212	0,22
Avolon Holdings Funding Ltd.				
2,528 % fällig am 18.11.2027	$	1.340	1.131	0,08
Banca Monte dei Paschi di Siena SpA				
1,875 % fällig am 09.01.2026	€	3.000	2.915	0,20
2,625 % fällig am 28.04.2025		1.980	2.028	0,14
6,750 % fällig am 02.03.2026		2.654	2.902	0,20
8,000 % fällig am 22.01.2030		481	472	0,03
Banco de Credito del Peru S.A.				
4,650 % fällig am 17.09.2024	PEN	600	159	0,01
Barclays PLC				
6,224 % fällig am 09.05.2034	$	1.355	1.351	0,09
Bevco Lux SARL				
1,000 % fällig am 16.01.2030	€	4.400	3.745	0,26
Corsair International Ltd.				
7,772 % fällig am 28.01.2027		1.000	1.086	0,07
Credit Suisse AG				
5,500 % fällig am 20.08.2026		3.200	3.548	0,24
Credit Suisse AG AT1 Claim ^	$	1.900	76	0,01
Cromwell Ereit Lux Finco SARL				
2,125 % fällig am 19.11.2025	€	167	157	0,01
Deutsche Bank AG				
3,547 % fällig am 18.09.2031	$	1.200	997	0,07
6,720 % fällig am 18.01.2029		200	200	0,01
EPR Properties				
4,750 % fällig am 15.12.2026	$	8	$ 7	0,00
4,950 % fällig am 15.04.2028		34	30	0,00
GLP Capital LP				
4,000 % fällig am 15.01.2030		100	87	0,01
5,300 % fällig am 15.01.2029		3.888	3.706	0,26
5,750 % fällig am 01.06.2028		500	490	0,03
HSBC Holdings PLC				
2,848 % fällig am 04.06.2031		5.900	4.899	0,34
Nationwide Building Society				
4,302 % fällig am 08.03.2029		2.100	1.948	0,13
Santander UK Group Holdings PLC				
6,750 % fällig am 24.06.2024 (h)(j)	£	4.169	4.972	0,34
SLM Student Loan Trust				
4,076 % fällig am 15.12.2033	€	3.162	3.184	0,22
Societe Generale S.A.				
6,447 % fällig am 12.01.2027	$	3.200	3.194	0,22
UBS AG				
5,125 % fällig am 15.05.2024 (j)		3.490	3.437	0,24
UBS Group AG				
4,194 % fällig am 01.04.2031		5.000	4.453	0,31
6,373 % fällig am 15.07.2026		2.400	2.385	0,16
6,442 % fällig am 11.08.2028		3.150	3.164	0,22
7,750 % fällig am 01.03.2029	€	1.400	1.694	0,12
UniCredit SpA				
7,830 % fällig am 04.12.2023	$	12.260	12.334	0,85
Unique Pub Finance Co. PLC				
7,395 % fällig am 28.03.2024	£	25	32	0,00
Uniti Group LP				
6,500 % fällig am 15.02.2029	$	1.875	1.329	0,09
10,500 % fällig am 15.02.2028		2.508	2.490	0,17
VICI Properties LP				
4,500 % fällig am 01.09.2026		2.000	1.891	0,13
4,500 % fällig am 15.01.2028		4.325	3.978	0,27
4,625 % fällig am 01.12.2029		4.900	4.453	0,31
			94.599	6,50
INDUSTRIEWERTE				
Alaska Airlines Pass-Through Trust				
4,800 % fällig am 15.02.2029		2.090	2.011	0,14
Altice France S.A.				
8,125 % fällig am 01.02.2027		3.400	2.948	0,20
American Airlines Pass-Through Trust				
3,375 % fällig am 01.11.2028		60	54	0,00
British Airways Pass-Through Trust				
4,250 % fällig am 15.05.2034		467	427	0,03
Broadcom, Inc.				
3,469 % fällig am 15.04.2034		2.453	2.013	0,14
Carvana Co.				
5,500 % fällig am 15.04.2027		120	80	0,01
10,250 % fällig am 01.05.2030		3.700	2.919	0,20
CDW LLC				
2,670 % fällig am 01.12.2026		6.460	5.808	0,40
Community Health Systems, Inc.				
5,625 % fällig am 15.03.2027		4.054	3.576	0,25
8,000 % fällig am 15.03.2026		742	724	0,05
CoStar Group, Inc.				
2,800 % fällig am 15.07.2030		1.300	1.074	0,07
DISH DBS Corp.				
5,250 % fällig am 01.12.2026		2.550	2.050	0,14
5,750 % fällig am 01.12.2028		2.520	1.879	0,13
Intelsat Jackson Holdings S.A.				
6,500 % fällig am 15.03.2030		3.297	3.010	0,21
JetBlue Pass-Through Trust				
4,000 % fällig am 15.05.2034		2.760	2.521	0,17
Market Bidco Finco PLC				
4,750 % fällig am 04.11.2027	€	2.100	1.850	0,13
Mitchells & Butlers Finance PLC				
6,013 % fällig am 15.12.2030	£	36	41	0,00
Motorola Solutions, Inc.				
2,300 % fällig am 15.11.2030	$	4.383	3.543	0,24
Nissan Motor Co. Ltd.				
4,345 % fällig am 17.09.2027		2.800	2.549	0,18
4,810 % fällig am 17.09.2030		300	263	0,02
NMG Holding Co., Inc.				
7,125 % fällig am 01.04.2026		400	373	0,03
NPC Ukrenergo				
6,875 % fällig am 09.11.2028 ^	$	200	$ 43	0,00
Petroleos de Venezuela S.A.				
6,000 % fällig am 16.05.2024 ^		220	9	0,00
Petroleos Mexicanos				
5,950 % fällig am 28.01.2031		4.300	3.145	0,22
6,700 % fällig am 16.02.2032		1.831	1.394	0,10
Prime Healthcare Services, Inc.				
7,250 % fällig am 01.11.2025		6.355	6.030	0,41
RegionalCare Hospital Partners Holdings, Inc.				
9,750 % fällig am 01.12.2026		4.100	3.444	0,24
Rolls-Royce PLC				
5,750 % fällig am 15.10.2027	£	1.100	1.300	0,09
Royal Caribbean Cruises Ltd.				
11,500 % fällig am 01.06.2025	$	876	930	0,06
Sands China Ltd.				
4,300 % fällig am 08.01.2026		1.400	1.317	0,09
Surgery Center Holdings, Inc.				
10,000 % fällig am 15.04.2027		1.825	1.868	0,13
T-Mobile USA, Inc.				
4,800 % fällig am 15.07.2028		7.000	6.859	0,47
Topaz Solar Farms LLC				
4,875 % fällig am 30.09.2039		37	34	0,00
5,750 % fällig am 30.09.2039		199	195	0,01
U.S. Renal Care, Inc.				
10,625 % fällig am 15.07.2027		40	10	0,00
United Airlines Pass-Through Trust				
3,100 % fällig am 07.01.2030		1.987	1.800	0,12
4,150 % fällig am 25.02.2033		525	482	0,03
5,875 % fällig am 15.04.2029		3.378	3.353	0,23
Valaris Ltd.				
8,375 % fällig am 30.04.2030		942	946	0,07
Venture Global Calcasieu Pass LLC				
3,875 % fällig am 15.08.2029		300	262	0,02
4,125 % fällig am 15.08.2031		300	258	0,02
Venture Global LNG, Inc.				
8,125 % fällig am 01.06.2028		900	915	0,06
8,375 % fällig am 01.06.2031		900	909	0,06
Viking Cruises Ltd.				
13,000 % fällig am 15.05.2025		3.600	3.783	0,26
Windstream Escrow LLC				
7,750 % fällig am 15.08.2028		2.373	1.972	0,14
			80.971	5,57
VERSORGUNGSUNTERNEHMEN				
Gazprom PJSC Via Gaz Finance PLC				
2,950 % fällig am 15.04.2025	€	11.000	9.301	0,64
Pacific Gas & Electric Co.				
2,100 % fällig am 01.08.2027	$	3.785	3.236	0,22
2,950 % fällig am 01.03.2026 ^		1.772	1.624	0,11
3,300 % fällig am 15.03.2027 ^		773	702	0,05
3,300 % fällig am 01.12.2027 ^		7.662	6.724	0,46
3,400 % fällig am 15.08.2024 ^		2.173	2.103	0,15
3,450 % fällig am 01.07.2025		1.869	1.765	0,12
3,500 % fällig am 15.06.2025 ^		1.437	1.361	0,09
3,750 % fällig am 15.02.2024 ^		1.490	1.466	0,10
3,750 % fällig am 01.07.2028		1.459	1.309	0,09
3,750 % fällig am 15.08.2042 ^		12	8	0,00
4,000 % fällig am 01.12.2046 ^		2	1	0,00
4,300 % fällig am 15.03.2045 ^		61	44	0,00
4,450 % fällig am 15.04.2042 ^		66	50	0,00
4,500 % fällig am 15.12.2041 ^		26	19	0,00
4,550 % fällig am 01.07.2030		4.717	4.273	0,30
4,950 % fällig am 08.06.2025		2.600	2.521	0,17
4,950 % fällig am 01.07.2050		1.381	1.087	0,08
Rio Oil Finance Trust				
8,200 % fällig am 06.04.2028		904	909	0,06
9,750 % fällig am 06.01.2027		517	534	0,04
Sprint LLC				
7,125 % fällig am 15.06.2024		2.868	2.896	0,20
			41.933	2,88
Summe Unternehmensanleihen und Wechsel			217.503	14,95
WANDELANLEIHEN & WECHSEL				
DISH Network Corp.				
2,375 % fällig am 15.03.2024		600	534	0,04

BESCHREIBUNG		PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
US-REGIERUNGSBEHÖRDEN				
Ginnie Mae, TBA				
2,500 % fällig am 01.07.2053	$	900	$ 780	0,05
3,000 % fällig am 01.08.2053		500	447	0,03
3,500 % fällig am 01.08.2053		5.000	4.621	0,32
4,000 % fällig am 01.08.2053		2.700	2.557	0,18
4,500 % fällig am 01.07.2053		10.900	10.521	0,72
5,000 % fällig am 01.07.2053		1.000	983	0,07
Uniform Mortgage-Backed Security				
3,500 % fällig am 01.11.2047		90	83	0,01
4,000 % fällig am 01.11.2042 - 01.03.2049		1.716	1.633	0,11
Uniform Mortgage-Backed Security, TBA				
2,500 % fällig am 01.08.2053		20.600	17.497	1,20
3,000 % fällig am 01.08.2053		28.150	24.815	1,70
3,500 % fällig am 01.08.2053		89.750	81.879	5,63
4,000 % fällig am 01.08.2053		128.650	120.846	8,30
4,500 % fällig am 01.08.2053		31.100	29.917	2,06
5,000 % fällig am 01.08.2053		56.500	55.375	3,80
5,500 % fällig am 01.07.2053		189.500	188.569	12,96
6,000 % fällig am 01.07.2053		166.000	167.408	11,50
6,500 % fällig am 01.07.2053		66.200	67.564	4,64
			775.495	53,28
US-SCHATZOBLIGATIONEN				
U.S. Treasury Bonds				
2,875 % fällig am 15.05.2049		4.900	4.054	0,28
U.S. Treasury Inflation Protected Securities (g)				
0,125 % fällig am 15.07.2024		28.039	27.201	1,87
0,125 % fällig am 15.10.2024		23.159	22.341	1,54
0,125 % fällig am 15.04.2025		3.523	3.352	0,23
0,125 % fällig am 15.07.2030		3.099	2.781	0,19
0,125 % fällig am 15.01.2031		233	207	0,01
0,125 % fällig am 15.07.2031		226	201	0,01
0,250 % fällig am 15.01.2025		8.452	8.103	0,56
0,250 % fällig am 15.07.2029		4.983	4.551	0,31
0,250 % fällig am 15.02.2050		1.298	909	0,06
0,375 % fällig am 15.07.2023		9.879	9.872	0,68
0,375 % fällig am 15.01.2027		222	209	0,02
0,375 % fällig am 15.07.2027		62	58	0,00
0,500 % fällig am 15.04.2024		9.609	9.377	0,64
0,625 % fällig am 15.01.2024		17.172	16.882	1,16
0,625 % fällig am 15.07.2032		9.187	8.449	0,58
0,750 % fällig am 15.07.2028		1.172	1.111	0,08
0,750 % fällig am 15.02.2042		403	342	0,02
0,750 % fällig am 15.02.2045		1.030	852	0,06
0,875 % fällig am 15.01.2029		2.374	2.248	0,16
0,875 % fällig am 15.02.2047		1.633	1.372	0,09
1,000 % fällig am 15.02.2046		640	556	0,04
1,000 % fällig am 15.02.2048		1.722	1.483	0,10
1,000 % fällig am 15.02.2049		3.387	2.916	0,20
1,375 % fällig am 15.02.2044		130	123	0,01
2,125 % fällig am 15.02.2040		281	301	0,02
2,125 % fällig am 15.02.2041		139	149	0,01
U.S. Treasury Notes				
2,375 % fällig am 31.03.2029		15.600	14.245	0,98
2,875 % fällig am 15.05.2032		4.500	4.173	0,29
			148.418	10,20
NON-AGENCY-MBS				
20 Times Square Trust				
3,203 % fällig am 15.05.2035		3.800	3.195	0,22
225 Liberty Street Trust				
4,803 % fällig am 10.02.2036		1.023	709	0,05
280 Park Avenue Mortgage Trust				
6,262 % fällig am 15.09.2034		9.300	8.683	0,60
Ashford Hospitality Trust				
6,769 % fällig am 15.06.2035		100	97	0,01
7,169 % fällig am 15.06.2035		4.100	3.929	0,27
8,069 % fällig am 15.06.2035		100	95	0,01
Atlas Funding PLC				
5,937 % fällig am 20.01.2061	£	9.901	12.600	0,87
Atrium Hotel Portfolio Trust				
6,873 % fällig am 15.06.2035	$	288	275	0,02
Bear Stearns ALT-A Trust				
3,859 % fällig am 25.09.2035 ^		2.139	882	0,06
Brants Bridge PLC				
0,000 % fällig am 14.06.2066 (b)	£	5.300	6.706	0,46
BX Trust				
6,561 % fällig am 15.11.2032	$	665	$ 656	0,04
6,711 % fällig am 15.11.2032		1.400	1.372	0,09
7,213 % fällig am 15.05.2035		1.080	1.060	0,07
Canada Square Funding PLC				
5,316 % fällig am 17.01.2059	£	11.805	14.922	1,03
ChaseFlex Trust				
5,830 % fällig am 25.05.2037	$	14	13	0,00
Chevy Chase Funding LLC Mortgage-Backed Certificates				
5,037 % fällig am 25.08.2035		1.132	881	0,06
Citigroup Commercial Mortgage Trust				
3,635 % fällig am 10.05.2035		15.420	14.036	0,96
6,668 % fällig am 15.12.2036		2.500	2.442	0,17
Commercial Mortgage Trust				
6,293 % fällig am 15.09.2033		2.800	2.569	0,18
Countrywide Alternative Loan Trust				
4,704 % fällig am 25.08.2035		1.076	935	0,06
5,476 % fällig am 25.11.2035		6	5	0,00
5,577 % fällig am 20.03.2046		10	8	0,00
5,610 % fällig am 25.03.2036		41	39	0,00
5,650 % fällig am 25.12.2046		2.009	1.637	0,11
5,710 % fällig am 25.08.2035		359	319	0,02
6,016 % fällig am 25.11.2035		6	5	0,00
6,250 % fällig am 25.04.2037		1.491	768	0,05
Credit Suisse Mortgage Capital Mortgage-Backed Trust				
6,000 % fällig am 25.04.2036		2.381	691	0,05
Credit Suisse Mortgage Capital Trust				
7,093 % fällig am 15.07.2032		15.277	13.873	0,95
Dutch Property Finance BV				
4,168 % fällig am 28.04.2064	€	12.242	13.389	0,92
GreenPoint Mortgage Funding Trust				
5,550 % fällig am 25.05.2037	$	1.845	1.724	0,12
GS Mortgage Securities Corp. Trust				
7,290 % fällig am 15.07.2025		12.240	11.936	0,82
GS Mortgage Securities Trust				
3,750 % fällig am 25.10.2057		4.004	3.798	0,26
GSR Mortgage Loan Trust				
6,000 % fällig am 25.05.2037 ^		168	123	0,01
HarborView Mortgage Loan Trust				
5,347 % fällig am 19.09.2037		1.634	1.432	0,10
Harbour				
5,358 % fällig am 28.01.2054	£	4.120	5.217	0,36
5,457 % fällig am 28.01.2054		14.047	17.615	1,21
Hilton Orlando Trust				
6,743 % fällig am 15.12.2034	$	7.500	7.374	0,51
HomeBanc Mortgage Trust				
5,960 % fällig am 25.10.2035		100	85	0,01
HSI Asset Securitization Corp. Trust				
5,870 % fällig am 25.08.2035		165	156	0,01
JPMorgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust				
7,493 % fällig am 15.02.2035		2.664	2.541	0,17
Jupiter Mortgage PLC				
5,891 % fällig am 20.07.2060	£	1.394	1.767	0,12
Kinbane DAC				
4,263 % fällig am 25.09.2062	€	17.129	18.543	1,27
Lanebrook Mortgage Transaction PLC				
6,715 % fällig am 12.06.2057	£	4.282	5.451	0,37
8,115 % fällig am 12.06.2057		1.000	1.259	0,09
Lehman XS Trust				
5,550 % fällig am 25.08.2046	$	7.482	6.865	0,47
Morgan Stanley Capital Trust				
6,843 % fällig am 15.07.2035		7.056	6.923	0,48
7,143 % fällig am 15.07.2035		3.014	2.945	0,20
Mortimer BTL PLC				
6,365 % fällig am 23.06.2053	£	1.000	1.228	0,08
Natixis Commercial Mortgage Securities Trust				
3,917 % fällig am 15.11.2032	$	7.453	6.349	0,44
PHH Alternative Mortgage Trust				
6,000 % fällig am 25.02.2037		3.673	3.038	0,21
Precise Mortgage Funding PLC				
5,657 % fällig am 16.10.2056	£	803	1.020	0,07
Residential Accredit Loans, Inc. Trust				
5,510 % fällig am 25.07.2036	$	1.313	1.138	0,08
5,650 % fällig am 25.08.2037		400	366	0,03
Residential Asset Securitization Trust				
6,609 % fällig am 25.02.2037		10.845	2.682	0,18
Residential Funding Mortgage Securities, Inc. Trust				
6,250 % fällig am 25.08.2036	$	1.104	$ 919	0,06
RESIMAC Bastille Trust				
6,093 % fällig am 05.09.2057		45	45	0,00
Shamrock Residential DAC				
4,289 % fällig am 24.01.2061	€	22.460	24.247	1,67
4,439 % fällig am 24.06.2071		13.619	14.710	1,01
4,689 % fällig am 24.02.2071		11.839	12.842	0,88
Stratton BTL Mortgage Funding PLC				
5,491 % fällig am 20.01.2054	£	3.000	3.673	0,25
Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust				
4,984 % fällig am 25.09.2034	$	169	161	0,01
TBW Mortgage-Backed Trust				
5,965 % fällig am 25.07.2037		113	36	0,00
Temple Quay PLC				
6,024 % fällig am 24.07.2085	£	13.457	17.068	1,17
Tharaldson Hotel Portfolio Trust				
6,241 % fällig am 11.11.2034	$	227	224	0,02
Thornburg Mortgage Securities Trust				
4,795 % fällig am 25.12.2042		80	74	0,01
Towd Point Mortgage Funding PLC				
5,635 % fällig am 20.10.2051	£	2.730	3.476	0,24
5,841 % fällig am 20.07.2045		1.175	1.495	0,10
6,216 % fällig am 20.02.2045		1.483	1.882	0,13
6,546 % fällig am 20.02.2054		4.179	5.315	0,37
Trinidad Mortgage Securities PLC				
5,443 % fällig am 24.01.2059		6	7	0,00
Trinity Square PLC				
7,216 % fällig am 15.07.2059		1.000	1.247	0,09
Twin Bridges PLC				
0,000 % fällig am 14.06.2055		10.000	12.674	0,87
Verus Securitization Trust				
1,977 % fällig am 25.03.2060	$	84	81	0,01
3,035 % fällig am 25.03.2060		100	95	0,01
3,889 % fällig am 25.03.2060		200	188	0,01
WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust				
3,669 % fällig am 25.02.2037 ^		701	634	0,04
5,910 % fällig am 25.01.2045		79	76	0,01
			319.535	21,96
FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE				
ACE Securities Corp. Home Equity Loan Trust				
5,590 % fällig am 25.05.2037		8.349	1.433	0,10
Aegis Asset-Backed Securities Trust Mortgage Pass-Through Certificates				
7,100 % fällig am 25.06.2034		1.784	1.658	0,11
Amortizing Residential Collateral Trust				
5,850 % fällig am 25.10.2031		182	175	0,01
Argent Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates				
5,915 % fällig am 25.10.2035		100	89	0,01
Asset-Backed Securities Corp. Home Equity Loan Trust				
2,822 % fällig am 25.07.2036		4.140	3.930	0,27
3,545 % fällig am 25.05.2036		6.170	5.617	0,39
Auto Abs Spanish Loans				
5,929 % fällig am 28.02.2032	€	2.686	2.849	0,20
Bayview Financial Asset Trust				
6,650 % fällig am 25.03.2037	$	434	434	0,03
Carrington Mortgage Loan Trust				
6,140 % fällig am 25.06.2035		3.528	3.436	0,24
College Avenue Student Loans LLC				
4,130 % fällig am 26.12.2047		20	19	0,00
6,350 % fällig am 26.12.2047		20	20	0,00
Countrywide Asset-Backed Certificates				
6,350 % fällig am 25.10.2035		932	914	0,06
Countrywide Asset-Backed Certificates Trust				
5,290 % fällig am 25.06.2047		1.856	1.707	0,12
5,360 % fällig am 25.05.2047 ^		6.496	5.650	0,39
Denali Capital CLO Ltd.				
6,310 % fällig am 15.04.2031		1.792	1.768	0,12
First Franklin Mortgage Loan Trust				
5,555 % fällig am 25.04.2036		1.000	725	0,05
Fremont Home Loan Trust				
5,300 % fällig am 25.10.2036		1.270	519	0,04
GSAA Home Equity Trust				
5,530 % fällig am 25.03.2036		2.373	869	0,06

Aufstellung des Wertpapierbestands des Low Duration Income Fund (Fort.)

BESCHREIBUNG		PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
GSAMP Trust				
5,870 % fällig am 25.11.2035	$	2.100	$ 1.699	0,12
Harvest SBA Loan Trust				
7,388 % fällig am 25.08.2044		163	159	0,01
Home Equity Mortgage Loan Asset-Backed Trust				
5,310 % fällig am 25.07.2037		377	202	0,01
5,350 % fällig am 25.07.2037		5.053	2.712	0,19
HSI Asset Securitization Corp. Trust				
5,290 % fällig am 25.12.2036		8.705	7.316	0,50
5,340 % fällig am 25.01.2037		2.866	1.982	0,14
IXIS Real Estate Capital Trust				
5,610 % fällig am 25.01.2037		3.423	1.245	0,08
JPMorgan Mortgage Acquisition Trust				
5,410 % fällig am 25.06.2037		335	334	0,02
Lehman XS Trust				
5,670 % fällig am 25.05.2046 ^		1.393	1.244	0,09
6,500 % fällig am 25.06.2046		50	42	0,00
7,450 % fällig am 25.12.2037		1.298	1.315	0,09
Long Beach Mortgage Loan Trust				
5,430 % fällig am 25.06.2036		481	441	0,03
5,750 % fällig am 25.01.2036		3.069	2.799	0,19
Man GLG Euro CLO DAC				
3,917 % fällig am 15.10.2030	€	2.908	3.109	0,21
Merrill Lynch Mortgage Investors Trust				
5,430 % fällig am 25.05.2037	$	4.400	2.332	0,16
5,450 % fällig am 25.08.2037		283	265	0,02
Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust				
3,580 % fällig am 25.01.2035		1.330	1.022	0,07
5,350 % fällig am 25.05.2037		927	513	0,03
5,450 % fällig am 25.06.2036		1.856	1.568	0,11
6,065 % fällig am 25.03.2035		829	817	0,06
New Century Home Equity Loan Trust				
5,870 % fällig am 25.10.2035		439	420	0,03
NovaStar Mortgage Funding Trust				
6,725 % fällig am 25.12.2034		3.425	3.255	0,22
Oak Hill European Credit Partners DAC				
3,930 % fällig am 20.01.2032	€	2.596	2.768	0,19
OHA Loan Funding Ltd.				
6,363 % fällig am 23.07.2031	$	3.000	2.974	0,20
Option One Mortgage Loan Trust				
5,400 % fällig am 25.03.2037		4.999	2.470	0,17
5,915 % fällig am 25.08.2035		2.000	1.888	0,13
6,575 % fällig am 25.11.2034		835	833	0,06
Park Place Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates				
6,725 % fällig am 25.02.2035		8.704	8.417	0,58
People's Choice Home Loan Securities Trust				
7,175 % fällig am 25.10.2034		477	390	0,03
Pretium Mortgage Credit Partners LLC				
2,487 % fällig am 25.07.2051		1.985	1.842	0,13
Renaissance Home Equity Loan Trust				
5,580 % fällig am 25.11.2036		1.235	454	0,03
Residential Asset Mortgage Products Trust				
6,230 % fällig am 25.03.2035		2.000	1.902	0,13
Saxon Asset Securities Trust				
5,490 % fällig am 25.10.2046		4.845	4.685	0,32
SoFi Professional Loan Program LLC				
2,630 % fällig am 25.07.2040		197	195	0,01
Specialty Underwriting & Residential Finance Trust				
5,350 % fällig am 25.11.2037		366	203	0,01
Starwood Commercial Mortgage Trust				
6,296 % fällig am 15.07.2038		6.260	6.207	0,43
Structured Asset Investment Loan Trust				
5,870 % fällig am 25.01.2036		471	450	0,03
6,150 % fällig am 25.09.2034		1.926	1.877	0,13
Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust				
5,380 % fällig am 25.05.2047		192	182	0,01
6,125 % fällig am 25.05.2035		2.900	2.840	0,19
Terwin Mortgage Trust				
6,530 % fällig am 25.03.2035		406	378	0,03
Wells Fargo Home Equity Asset-Backed Securities Trust				
5,900 % fällig am 25.12.2035		701	685	0,05
6,875 % fällig am 25.11.2035		5.050	4.972	0,34
			113.215	7,78

BESCHREIBUNG		PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
STAATSEMISSIONEN				
Argentina Government International Bond				
0,500 % fällig am 09.07.2030	$	2.796	$ 854	0,06
1,000 % fällig am 09.07.2029		120	39	0,00
1,500 % fällig am 09.07.2035		1.732	510	0,03
3,500 % fällig am 09.07.2041		3.129	1.008	0,07
15,500 % fällig am 17.10.2026	ARS	1.188	0	0,00
Australia Government International Bond				
1,750 % fällig am 21.06.2051	AUD	2.500	969	0,07
Autonome Stadt Buenos Aires				
95,317 % fällig am 29.03.2024 (a)	ARS	610	1	0,00
Peru Government International Bond				
5,350 % fällig am 12.08.2040	PEN	1.022	237	0,01
5,400 % fällig am 12.08.2034		1	0	0,00
6,150 % fällig am 12.08.2032		88	23	0,00
6,950 % fällig am 12.08.2031		59	17	0,00
Provincia de Buenos Aires				
88,734 % fällig am 12.04.2025 (a)	ARS	6.240	11	0,00
Romania Government International Bond				
2,000 % fällig am 14.04.2033	€	2.500	1.932	0,13
3,750 % fällig am 07.02.2034		1.200	1.061	0,07
Russia Government International Bond				
4,250 % fällig am 23.06.2027 ^	$	5.600	2.436	0,17
4,750 % fällig am 27.05.2026 ^		200	101	0,01
5,250 % fällig am 23.06.2047 ^		200	89	0,01
5,250 % fällig am 23.06.2047 ^		400	24	0,00
7,150 % fällig am 12.11.2025 ^	RUB	19.414	114	0,01
7,950 % fällig am 07.10.2026 ^		13.158	77	0,01
South Africa Government International Bond				
10,500 % fällig am 21.12.2026	ZAR	193.200	10.622	0,73
Turkey Government International Bond				
4,250 % fällig am 13.03.2025	$	1.200	1.122	0,08
5,250 % fällig am 13.03.2030		1.000	823	0,06
5,750 % fällig am 11.05.2047		741	508	0,03
Venezuela Government International Bond				
8,250 % fällig am 13.10.2024 ^		2.000	185	0,01
9,000 % fällig am 07.05.2023 ^		1.600	144	0,01
			22.907	1,57

	AKTIEN		
STAMMAKTIEN			
KOMMUNIKATIONSDIENSTE			
Clear Channel Outdoor Holdings, Inc. (d)	173.174	237	0,02
iHeartMedia, Inc. 'A' (d)	41.444	151	0,01
iHeartMedia, Inc. 'B' (d)	32.182	105	0,01
Intelsat Emergence S.A. (d)(k)	45.479	1.046	0,07
		1.539	0,11
BASISKONSUMGÜTER			
Neiman Marcus Group Ltd. LLC (d)(k)	5.145	782	0,05
INDUSTRIEWERTE			
Westmoreland Mining Holdings LLC (d)(k)	231	1	0,00
IMMOBILIEN			
Adler Group S.A. (d)	64.865	34	0,00
Adler Group S.A.	143.630	87	0,01
		121	0,01
		2.443	0,17

BESCHREIBUNG	AKTIEN	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
RECHTE			
Intelsat Jackson Holdings S.A. - Exp. 05.12.2025	9.740	58	0,00
OPTIONSSCHEINE			
Intelsat Emergence S.A. - Exp. 17.02.2027	661	1	0,00
Windstream Holdings II, LLC - Exp. 21.09.2055	361	$ 6	0,00
		7	0,00
REAL ESTATE INVESTMENT TRUSTS			
CBL & Associates Properties, Inc.	174	4	0,00
Uniti Group, Inc.	247	1	0,00
		5	0,00

		PAR (000S)		
KURZFRISTIGE INSTRUMENTE				
KURZFRISTIGE SCHULDTITEL				
Federal Home Loan Bank				
5,170 % fällig am 29.11.2023	$	27.300	27.312	1,87
ARGENTINA TREASURY BILLS				
(28,578) % fällig am 18.10.2023 (e)(f)	ARS	75.997	150	0,01
(12,549) % fällig am 23.11.2023 (e)(f)		270.916	547	0,04
			697	0,05
JAPAN TREASURY BILLS				
(0,206) % fällig am 18.07.2023 (e)(f)	¥	193.000	1.335	0,09
(0,200) % fällig am 24.07.2023 (e)(f)		330.000	2.283	0,16
(0,199) % fällig am 11.09.2023 (e)(f)		1.523.000	10.540	0,72
(0,197) % fällig am 31.07.2023 (e)(f)		93.000	644	0,05
(0,197) % fällig am 28.08.2023 (e)(f)		2.220.000	15.363	1,06
(0,188) % fällig am 18.07.2023 (e)(f)		92.000	637	0,04
(0,184) % fällig am 04.09.2023 (e)(f)		510.000	3.529	0,24
(0,179) % fällig am 11.09.2023 (e)(f)		340.000	2.353	0,16
(0,178) % fällig am 31.07.2023 (e)(f)		27.000	187	0,01
(0,169) % fällig am 19.09.2023 (e)(f)		750.000	5.190	0,36
(0,150) % fällig am 25.09.2023 (e)(f)		691.000	4.782	0,33
			46.843	3,22
Summe kurzfristige Instrumente			74.852	5,14
Summe Übertragbare Wertpapiere			**$ 1.708.028**	**117,36**

	AKTIEN		
INVESTMENTFONDS			
ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN			
PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (i)	14.658.227	145.966	10,03
Summe Investmentfonds		**$ 145.966**	**10,03**

* Das Engagement des Low Duration Income Fund in den Anlagefonds stieg etwas über 10 %. Ab dem 3. Juli 2023 erfüllte der Fonds die Vorgaben wieder.

PENSIONSGESCHÄFTE

Kontrahent	Kredit-zins	Abrechnungs-datum	Fälligkeits-datum	Kapital-betrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensions-geschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensions-geschäft[1]	% des Nettovermögens
BPS	5,120 %	30.06.2023	03.07.2023	$ 276.200	U.S. Treasury Notes 0,250 % fällig am 31.07.2025	$ (281.598)	$ 276.200	$ 276.318	18,97
	5,170	30.06.2023	03.07.2023	46.400	Ginnie Mae 2,500 % fällig am 20.10.2051	(48.032)	46.400	46.420	3,19
FICC	2,400	30.06.2023	03.07.2023	3.892	U.S. Treasury Notes 4,625 % fällig am 30.06.2025	(3.970)	3.892	3.892	0,27
Summe Pensionsgeschäfte						**$ (333.600)**	**$ 326.492**	**$ 326.630**	**22,43**

(1) Umfasst aufgelaufene Zinsen.

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

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

FUTURES

Beschreibung	Art	Ablauf-monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
3-Month SOFR December Futures	Short	03.2024	42	$ 280	0,02
3-Month SOFR December Futures	Short	03.2025	22	97	0,01
3-Month SOFR December Futures	Short	03.2026	23	75	0,01
3-Month SOFR June Futures	Short	09.2024	29	170	0,01
3-Month SOFR June Futures	Short	09.2025	22	80	0,01
3-Month SOFR March Futures	Short	06.2024	35	224	0,01
3-Month SOFR March Futures	Short	06.2025	20	79	0,01
3-Month SOFR March Futures	Short	06.2026	21	65	0,00
3-Month SOFR September Futures	Short	12.2024	26	132	0,01
3-Month SOFR September Futures	Short	12.2025	17	58	0,00
Euro-Bund 10-Year Bond September Futures	Short	09.2023	53	73	0,01
U.S. Treasury 5-Year Note September Futures	Short	09.2023	81	168	0,01
U.S. Treasury 10-Year Note September Futures	Short	09.2023	927	1.857	0,12
U.S. Treasury 10-Year Ultra September Futures	Long	09.2023	23	(26)	0,00
U.S. Treasury 30-Year Bond September Futures	Short	09.2023	16	(2)	0,00
U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond September Futures	Short	09.2023	82	(136)	(0,01)
				$ 3.194	0,22

VERKAUFSOPTIONEN

OPTIONEN AUF BÖRSENGEHANDELTE TERMINKONTRAKTE

Beschreibung	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Anzahl der Kontrakte	Aufgeld	Markt-wert	% des Nettovermögens
Put - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note August Futures	$ 111,500	21.07.2023	80	$ (35)	$ (30)	0,00
Call - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note August Futures	115,500	21.07.2023	80	(28)	(4)	0,00
Put - CBOT U.S. Treasury 30-Year Bond August Futures	123,000	21.07.2023	15	(6)	(2)	0,00
Call - CBOT U.S. Treasury 30-Year Bond August Futures	131,000	21.07.2023	15	(8)	(3)	0,00
Call - CME-Kaufoptionen mit Ausübungskurs bei 96,000 USD auf 3-Month SOFR September Futures	96,000	15.09.2023	33	(54)	(2)	0,00
Call - CME-Kaufoptionen mit Ausübungskurs bei 96,063 USD auf 3-Month SOFR December Futures	96,063	15.12.2023	35	(72)	(7)	0,00
Call - CME-Kaufoptionen mit Ausübungskurs bei 96,125 USD auf 3-Month SOFR December Futures	96,125	15.12.2023	33	(61)	(7)	0,00
Call - CME-Kaufoptionen mit Ausübungskurs bei 96,188 USD auf 3-Month SOFR September Futures	96,188	15.09.2023	50	(97)	(3)	0,00
Call - CME-Kaufoptionen mit Ausübungskurs bei 96,375 USD auf 3-Month SOFR December Futures	96,375	15.12.2023	50	(104)	(8)	0,00
Call - CME-Kaufoptionen mit Ausübungskurs bei 98,000 USD auf 3-Month SOFR December Futures	98,000	15.12.2023	50	(41)	(3)	0,00
Put - CME-Verkaufsoptionen mit Ausübungskurs bei 96,000 USD auf 3-Month SOFR September Futures	96,000	15.09.2023	33	(63)	(116)	(0,01)
Put - CME-Verkaufsoptionen mit Ausübungskurs bei 96,063 USD auf 3-Month SOFR December Futures	96,063	15.12.2023	35	(68)	(129)	(0,01)
Put - CME-Verkaufsoptionen mit Ausübungskurs bei 96,125 USD auf 3-Month SOFR December Futures	96,125	15.12.2023	33	(63)	(126)	(0,01)
Put - CME-Verkaufsoptionen mit Ausübungskurs bei 96,188 USD auf 3-Month SOFR September Futures	96,188	15.09.2023	50	(99)	(199)	(0,01)
Put - CME-Verkaufsoptionen mit Ausübungskurs bei 96,375 USD auf 3-Month SOFR December Futures	96,375	15.12.2023	50	(106)	(221)	(0,01)
Put - CME-Verkaufsoptionen mit Ausübungskurs bei 96,500 USD auf 3-Month SOFR December Futures	96,500	15.12.2023	50	(47)	(236)	(0,02)
				$ (952)	$ (1.096)	(0,07)
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate					**$ 2.098**	**0,15**

ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)

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

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMMISSIONEN - SCHUTZVERKAUF[1]

Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag[2]	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Airbus Finance BV	1,000 %	20.12.2025	€ 7.600	$ 205	0,02
Airbus Finance BV	1,000	20.06.2026	3.100	(31)	0,00
Airbus Finance BV	1,000	20.06.2028	200	(1)	0,00
AT&T, Inc.	1,000	20.06.2025	$ 700	22	0,00
AT&T, Inc.	1,000	20.12.2025	2.500	(15)	0,00
AT&T, Inc.	1,000	20.06.2026	1.500	(12)	0,00
AT&T, Inc.	1,000	20.06.2028	600	4	0,00
Boeing Co.	1,000	20.12.2023	1.000	9	0,00

Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag[2]	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Ford Motor Co.	5,000 %	20.12.2024	$ 2.600	$ (100)	(0,01)
Ford Motor Credit Co. LLC	5,000	20.06.2025	100	3	0,00
Ford Motor Credit Co. LLC	5,000	20.06.2026	100	5	0,00
Ford Motor Credit Co. LLC	5,000	20.06.2027	200	9	0,00
General Electric Co.	1,000	20.12.2023	400	30	0,00
General Electric Co.	1,000	20.06.2026	4.700	22	0,00
Rolls-Royce PLC	1,000	20.12.2025	€ 2.400	236	0,02
Rolls-Royce PLC	1,000	20.06.2027	1.100	60	0,00
Verizon Communications, Inc.	1,000	20.06.2026	$ 3.000	(45)	0,00
Verizon Communications, Inc.	1,000	20.12.2026	400	(7)	0,00
Verizon Communications, Inc.	1,000	20.06.2028	4.300	15	0,00
				$ 409	0,03

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES - SCHUTZVERKAUF[1]

Index/Tranchen	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag[2]	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
CDX.EM-31 5-Year Index	1,000 %	20.06.2024	$ 688	$ 27	0,00
CDX.EM-32 5-Year Index	1,000	20.12.2024	510	23	0,00
CDX.EM-34 5-Year Index	1,000	20.12.2025	1.196	6	0,00
CDX.EM-36 5-Year Index	1,000	20.12.2026	12.972	253	0,02
CDX.EM-38 5-Year Index	1,000	20.12.2027	1.300	57	0,00
CDX.EM-39 5-Year Index	1,000	20.06.2028	2.700	71	0,01
CDX.HY-36 5-Year Index	5,000	20.06.2026	5.782	(247)	(0,02)
CDX.HY-37 5-Year Index	5,000	20.12.2026	2.254	(11)	0,00
CDX.HY-39 5-Year Index	5,000	20.12.2027	11.187	189	0,01
CDX.HY-40 5-Year Index	5,000	20.06.2028	58.600	1.597	0,12
CDX.IG-40 5-Year Index	1,000	20.06.2028	2.300	16	0,00
				$ 1.981	0,14

ZINSSWAPS

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Zahlung	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	1,060 %	21.02.2052	£ 300	$ (179)	(0,01)
Zahlung	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	1,096	14.02.2052	600	(354)	(0,02)
Zahlung	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	1,101	21.02.2052	300	(176)	(0,01)
Zahlung	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	1,175	28.02.2052	600	(342)	(0,02)
Erhalt[3]	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	3,250	20.09.2053	1.900	170	0,01
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,000	15.03.2029	¥ 8.473.000	493	0,03
Zahlung	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,176	27.04.2027	550.000	1	0,00
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,400	15.06.2032	2.140.000	162	0,01
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,500	15.03.2042	1.140.000	246	0,02
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,711	27.04.2042	140.000	38	0,00
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	0,000	04.07.2023	$ 3.600	49	0,00
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	0,000	02.08.2023	1.000	14	0,00
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	0,000	04.08.2023	283.500	3.911	0,27
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	0,000	09.08.2023	1.100	(15)	0,00
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	0,000	06.09.2023	6.400	89	0,01
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	0,000	12.09.2023	15.700	(219)	(0,02)
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	0,000	16.09.2023	56.300	(803)	(0,05)
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	0,000	16.09.2023	400	6	0,00
Erhalt[3]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	0,500	16.06.2026	32.600	2.843	0,20
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	0,500	16.06.2026	56.300	5.046	0,35
Zahlung[3]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	0,500	16.06.2028	10.869	(1.109)	(0,08)
Zahlung[3]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	0,750	16.06.2031	76.933	(8.543)	(0,60)
Erhalt[3]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	0,928	06.05.2026	2.200	212	0,01
Erhalt[3]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	0,940	08.06.2026	2.900	269	0,02
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,000	15.06.2027	3.600	266	0,02
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,000	15.06.2029	4.070	368	0,03
Erhalt[3]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,000	16.12.2030	20.713	4.263	0,29
Erhalt[3]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,030	17.06.2026	3.600	323	0,02
Erhalt[3]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,235	12.05.2028	1.100	139	0,01
Erhalt[3]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,250	17.06.2030	4.400	462	0,03
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,250	15.06.2032	22.690	(2.238)	(0,15)
Erhalt[3]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,250	16.12.2050	12.600	3.739	0,26
Erhalt[3]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,250	16.06.2051	8.700	2.023	0,14
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,270	04.11.2023	283.500	(4.649)	(0,32)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,317	16.12.2050	400	(149)	(0,01)
Erhalt[3]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,360	15.02.2027	6.700	655	0,05
Erhalt[3]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,360	20.07.2031	1.400	245	0,02
Erhalt[3]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,370	19.07.2031	900	157	0,01
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,380	04.01.2027	3.600	(375)	(0,03)
Zahlung[3]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,418	20.01.2027	1.300	(125)	(0,01)
Zahlung[3]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,425	18.01.2027	2.500	(237)	(0,02)
Zahlung[3]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,438	22.01.2051	9.000	(3.185)	(0,22)
Erhalt[3]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,450	17.02.2027	6.300	597	0,04
Erhalt[3]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,450	16.07.2031	2.000	342	0,02

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Zahlung(3)	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,500 %	15.12.2028	$ 7.919	$ (1.112)	(0,08)
Erhalt(3)	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,500	18.12.2029	1.200	123	0,01
Zahlung(3)	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,500	05.10.2031	1.500	(247)	(0,02)
Erhalt(3)	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,500	17.06.2050	7.700	3.765	0,26
Zahlung(3)	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,518	20.01.2029	800	(99)	(0,01)
Zahlung(3)	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,535	15.10.2031	1.500	(243)	(0,02)
Zahlung(3)	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,535	22.10.2031	1.000	(161)	(0,01)
Zahlung(3)	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,545	26.10.2031	1.000	(161)	(0,01)
Zahlung(3)	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,570	12.01.2027	1.400	(128)	(0,01)
Zahlung(3)	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,580	16.02.2027	2.800	(246)	(0,02)
Zahlung(3)	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,580	13.01.2051	9.300	(3.127)	(0,21)
Erhalt(3)	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,600	16.01.2026	17.200	630	0,04
Zahlung(3)	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,600	15.02.2027	26.800	(2.321)	(0,16)
Erhalt(3)	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,625	06.01.2030	300	46	0,00
Zahlung(3)	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,630	26.01.2029	1.300	(153)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,650	08.02.2032	1.700	(258)	(0,02)
Zahlung(3)	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,655	24.01.2032	1.300	(202)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,700	06.03.2024	6.400	(152)	(0,01)
Zahlung(3)	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,700	17.02.2027	25.000	(2.076)	(0,14)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,730	24.02.2032	1.600	(232)	(0,02)
Zahlung(3)	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,735	12.01.2032	1.100	(166)	(0,01)
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,750	15.06.2025	38.000	1.154	0,08
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,750	15.06.2029	3.538	164	0,01
Erhalt(3)	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,750	15.01.2030	4.600	642	0,04
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,750	15.06.2032	1.608	68	0,00
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,750	15.06.2052	28.100	3.956	0,27
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,765	16.03.2032	600	(84)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,768	02.02.2032	1.000	(152)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,783	22.04.2027	2.100	(178)	(0,01)
Erhalt(3)	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,785	12.08.2051	1.100	349	0,02
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,788	03.05.2027	2.300	(193)	(0,01)
Zahlung(3)	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,815	24.01.2052	300	(88)	(0,01)
Zahlung(3)	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,867	26.01.2052	300	(85)	(0,01)
Erhalt(3)	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,910	17.10.2049	400	121	0,01
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,988	09.02.2032	1.100	145	0,01
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,000	21.12.2027	2.100	49	0,00
Erhalt(3)	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,000	10.12.2029	21.000	2.486	0,17
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,000	21.12.2029	11.170	143	0,01
Erhalt(3)	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,000	12.02.2030	2.500	323	0,02
Erhalt(3)	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,000	10.03.2030	1.200	133	0,01
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,000	21.12.2032	17.930	494	0,03
Erhalt(3)	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,008	09.02.2032	1.900	243	0,02
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,250	17.06.2027	5.600	(356)	(0,02)
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,250	12.03.2050	15.700	3.518	0,24
Erhalt(3)	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,300	17.01.2026	12.300	446	0,03
Erhalt(3)	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,350	17.01.2025	21.900	511	0,04
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,385	08.06.2032	1.400	115	0,01
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,436	08.06.2032	6.800	539	0,04
Erhalt(3)	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,450	20.12.2024	43.700	1.037	0,07
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,450	04.10.2027	5.430	414	0,03
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,451	08.06.2032	8.700	680	0,05
Erhalt(3)	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,543	05.02.2024	1.000	16	0,00
Erhalt(3)	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,550	05.02.2024	1.000	16	0,00
Erhalt(3)	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,559	05.02.2024	1.000	16	0,00
Erhalt(3)	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,571	05.02.2024	500	8	0,00
Erhalt(3)	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,580	05.02.2024	1.500	23	0,00
Erhalt(3)	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,605	05.02.2024	1.500	23	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,605	28.06.2027	3.900	(192)	(0,01)
Erhalt(3)	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,607	05.02.2024	500	8	0,00
Erhalt(3)	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,750	19.12.2023	19.100	(42)	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,900	04.10.2027	15.500	(748)	(0,05)
Erhalt(3)	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,000	19.06.2024	24.000	1.210	0,08
Erhalt(3)	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,000	19.06.2026	12.700	981	0,07
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,000	21.06.2030	85.750	3.413	0,23
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,000	21.06.2033	7.110	257	0,02
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,000	21.06.2033	270	(7)	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,050	07.09.2027	1.400	(60)	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,050	08.09.2029	1.400	(60)	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,050	06.09.2032	2.000	(86)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,080	23.02.2053	1.200	(22)	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,100	09.09.2029	1.400	(56)	0,00
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,250	21.06.2028	43.820	1.295	0,09
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,300	06.03.2033	2.000	(47)	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,340	23.02.2030	3.200	(79)	(0,01)
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,350	14.12.2032	500	15	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,370	01.03.2033	2.000	(34)	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,400	23.02.2033	3.200	(47)	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,405	01.03.2033	2.100	(30)	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,420	24.05.2033	7.600	(71)	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,430	27.02.2033	2.100	(26)	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,450	07.03.2033	3.900	(42)	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,470	22.02.2030	3.900	(65)	0,00

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,500 %	21.06.2026	$ 6.720	$ 178	0,01
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,500	22.06.2030	12.200	(109)	(0,01)
Erhalt(3)	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,500	20.12.2030	8.700	57	0,00
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,500	22.05.2033	29.710	(447)	(0,03)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,500	21.06.2033	8.100	(6)	0,00
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,610	12.12.2032	1.100	9	0,00
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,700	06.06.2033	66.350	(164)	(0,01)
Erhalt(3)	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,750	20.12.2028	13.900	84	0,01
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,800	10.03.2028	2.000	(17)	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	4,040	20.06.2024	7.900	(60)	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	4,060	20.06.2024	31.700	(234)	(0,02)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	4,140	22.06.2024	13.200	(87)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	4,500	22.05.2025	65.120	3	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	4,900	06.06.2025	144.940	(69)	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	5,100	22.05.2024	125.980	52	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	5,400	06.06.2024	281.160	245	0,02
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,140	02.01.2025	BRL 100	0	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,160	02.01.2025	100	0	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,220	04.01.2027	200	0	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,245	04.01.2027	100	0	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,260	04.01.2027	100	0	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,350	02.01.2025	100	0	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,715	04.01.2027	200	1	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,870	04.01.2027	500	3	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	12,000	02.01.2025	300	0	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	12,015	04.01.2027	57.400	406	0,03
Zahlung	1-Year BRL-CDI	12,080	02.01.2025	500	0	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	12,140	02.01.2025	300	0	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	12,145	02.01.2025	300	0	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	12,160	02.01.2025	500	1	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	0,000	04.07.2023	$ 3.600	(48)	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	0,000	02.08.2023	1.000	(14)	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	0,000	04.08.2023	283.500	(3.889)	(0,27)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	0,000	09.08.2023	1.100	15	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	0,000	06.09.2023	6.400	(90)	(0,01)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	0,000	12.09.2023	15.700	222	0,02
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	0,000	16.09.2023	56.300	809	0,06
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	0,000	16.09.2023	400	(6)	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	0,500	16.09.2023	21.731	285	0,02
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	0,750	16.09.2023	76.933	(958)	(0,07)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	0,928	06.08.2023	2.200	24	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	0,940	08.09.2023	2.900	34	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,000	16.09.2023	20.713	245	0,02
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,030	17.09.2023	3.600	40	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,235	12.08.2023	1.100	12	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,250	16.09.2023	21.300	233	0,02
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,250	17.09.2023	4.400	47	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,360	20.07.2023	1.400	9	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,360	15.08.2023	6.700	46	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,370	19.07.2023	900	6	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,418	20.07.2023	1.300	(8)	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,425	18.07.2023	2.500	(16)	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,438	22.07.2023	9.000	(56)	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,450	16.07.2023	2.000	12	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,450	17.08.2023	6.300	41	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,500	05.07.2023	1.500	(14)	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,500	15.09.2023	7.919	(83)	(0,01)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,500	17.09.2023	7.700	78	0,01
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,500	18.09.2023	1.200	12	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,518	20.07.2023	800	(5)	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,535	15.07.2023	1.500	(14)	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,535	22.07.2023	1.000	(10)	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,545	26.07.2023	1.000	(10)	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,570	12.07.2023	1.400	(8)	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,580	13.07.2023	9.300	(51)	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,580	16.08.2023	2.800	(16)	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,600	15.08.2023	26.800	(152)	(0,01)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,625	06.07.2023	300	2	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,630	26.07.2023	1.300	(7)	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,655	24.07.2023	1.300	(7)	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,700	17.08.2023	25.000	(130)	(0,01)
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,735	12.07.2023	1.100	(5)	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,750	15.07.2023	4.600	21	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,785	12.08.2023	1.100	6	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,815	24.07.2023	300	(1)	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,867	26.07.2023	300	(1)	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,910	17.07.2023	400	3	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,000	12.08.2023	2.500	10	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,000	10.09.2023	22.200	195	0,01
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,008	09.08.2023	1.900	7	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,543	05.08.2023	1.000	1	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,550	05.08.2023	1.000	1	0,00

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,559 %	05.08.2023	$ 1.000	$ 1	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,571	05.08.2023	500	1	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,580	05.08.2023	1.500	2	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,605	05.08.2023	1.500	1	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,607	05.08.2023	500	0	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,750	19.09.2023	19.100	136	0,01
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	3,000	19.09.2023	36.700	234	0,02
Zahlung	6-Month AUD-BBR-BBSW	3,000	21.03.2027	AUD 12.400	(651)	(0,04)
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	0,250	18.03.2050	€ 2.500	1.088	0,07
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	0,294	30.06.2026	100	12	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	0,329	30.12.2025	200	21	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	0,363	30.06.2025	300	26	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	0,395	30.12.2024	200	14	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	0,425	28.06.2024	300	14	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	0,453	29.12.2023	400	11	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	0,500	17.06.2050	600	280	0,02
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	0,550	10.08.2024	2.400	(107)	(0,01)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	0,650	11.05.2027	14.200	(1.478)	(0,10)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	0,700	11.04.2027	4.800	(503)	(0,03)
Erhalt[3]	6-Month EUR-EURIBOR	0,830	09.12.2052	27.100	1.174	0,08
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	1,000	13.05.2027	9.800	(919)	(0,06)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	1,000	18.05.2027	4.700	(441)	(0,03)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	1,750	21.09.2027	3.500	(209)	(0,01)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,100	11.04.2024	9.900	(155)	(0,01)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,100	13.04.2024	15.000	(237)	(0,02)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,100	17.05.2024	8.600	(146)	(0,01)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,250	26.04.2024	9.900	(137)	(0,01)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,250	28.04.2024	9.200	(137)	(0,01)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,250	03.05.2024	9.600	(143)	(0,01)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,547	09.03.2033	4.900	(109)	(0,01)
Erhalt[3]	6-Month EUR-EURIBOR	3,000	20.09.2033	11.600	(103)	(0,01)
Zahlung	UKRPI	4,000	15.09.2031	£ 900	(169)	(0,01)
Zahlung	UKRPI	4,020	15.10.2031	1.200	(218)	(0,02)
Zahlung	UKRPI	4,055	15.09.2031	800	(149)	(0,01)
Zahlung	UKRPI	4,066	15.09.2031	1.700	(286)	(0,02)
Zahlung	UKRPI	4,140	15.10.2031	2.300	(382)	(0,03)
					$ 13.070	0,89
Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate					**$ 15.460**	**1,06**

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

(2) Der maximal mögliche Betrag, den der Fonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

(3) Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft.

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

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

OPTIONSKAUF

ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag[1]	Kosten	Markt-wert	% des Nettovermögens
GLM	Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,110 %	26.07.2032	1.100	$ 178	$ 129	0,01
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,110	26.07.2032	1.600	259	319	0,02
MYC	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,053	20.07.2023	15.900	96	0	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,053	20.07.2023	15.900	96	350	0,02
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,620	22.07.2024	15.900	119	27	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,620	22.07.2024	15.900	119	247	0,02
	Call - OTC 2-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,590	19.07.2024	11.300	156	42	0,00
	Put - OTC 2-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,590	19.07.2024	11.300	155	287	0,02
	Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,400	20.07.2027	1.200	158	100	0,01
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,400	20.07.2027	1.400	185	230	0,02
	Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,170	19.07.2032	1.200	190	144	0,01
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,170	19.07.2032	1.400	222	271	0,02
							$ 1.933	$ 2.146	0,15

VERKAUFSOPTIONEN

ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag[1]	Aufgeld	Markt-wert	% des Nettovermögens
BOA	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,150 %	01.12.202	6.000	$ (19)	$ (1)	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,650	01.12.202	6.000	(19)	(81)	(0,01)
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,380	31.07.202	2.800	(11)	(13)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,780	31.07.202	2.800	(11)	(8)	0,00
	Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,070	10.07.202	2.800	(18)	(7)	0,00
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,370	10.07.202	2.800	(18)	(2)	0,01
	Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,060	14.07.202	1.000	(7)	(4)	0,00
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,360	14.07.202	1.000	(7)	(2)	0,00
BPS	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,200	06.07.202	2.300	(7)	0	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,650	06.07.202	2.300	(7)	(2)	0,00
	Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,000	03.07.202	3.600	(25)	0	0,00
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,400	03.07.202	3.600	(25)	0	0,00
BRC	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,260	26.07.202	1.200	(4)	(2)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,660	26.07.202	1.200	(4)	(6)	0,00
	Call - OTC 7-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,350	27.07.202	1.400	(3)	(3)	0,00
	Put - OTC 7-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,850	27.07.202	1.400	(3)	(5)	0,00
CBK	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,690	02.04.202	2.100	(17)	(2)	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,690	02.04.202	2.100	(17)	(39)	0,00
DUB	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,920	13.10.202	4.800	(29)	0	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,920	13.10.202	4.800	(29)	(103)	(0,01)
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,790	08.04.202	3.300	(25)	(4)	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,790	08.04.202	3.300	(25)	(57)	0,00
GLM	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,765	25.07.202	6.900	(43)	0	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,765	25.07.202	6.900	(43)	(172)	(0,01)
	Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,468	25.07.202	1.500	(36)	0	0,00
	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,468	25.07.202	1.500	(36)	(94)	(0,01)
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,920	13.10.202	4.800	(30)	0	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,920	13.10.202	4.800	(30)	(103)	(0,01)
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,018	20.10.202	3.900	(25)	0	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,018	20.10.202	3.900	(25)	(79)	(0,01)
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,140	23.10.202	3.900	(27)	(1)	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,140	23.10.202	3.900	(27)	(75)	(0,01)
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,190	23.10.202	3.900	(27)	(1)	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,190	23.10.202	3.900	(27)	(73)	(0,01)
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,225	23.10.202	3.900	(27)	(1)	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,225	23.10.202	3.900	(27)	(72)	0,00
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,973	25.10.202	3.900	(27)	(1)	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,973	25.10.202	3.900	(27)	(81)	(0,01)
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,841	27.10.202	3.800	(26)	0	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,841	27.10.202	3.800	(26)	(83)	(0,01)
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,088	03.11.202	3.800	(28)	(1)	0,01
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,088	03.11.202	3.800	(28)	(73)	(0,01)
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,910	10.11.202	3.700	(25)	(1)	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,910	10.11.202	3.700	(25)	(77)	(0,01)
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,250	17.11.202	7.200	(26)	(1)	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,750	17.11.202	7.200	(26)	(94)	(0,01)
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,150	20.11.202	7.200	(25)	(1)	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,650	20.11.202	7.200	(25)	(100)	(0,01)
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,250	07.12.202	6.100	(19)	(1)	0,01
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,750	07.12.202	6.100	(19)	(76)	(0,01)
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,697	02.04.202	12.300	(97)	(15)	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,697	02.04.202	12.300	(97)	(226)	(0,01)
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,721	08.04.202	4.100	(31)	(5)	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,721	08.04.202	4.100	(31)	(74)	(0,01)
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,260	26.07.202	2.300	(8)	(5)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,660	26.07.202	2.300	(8)	(11)	0,00
	Call - OTC 7-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,350	27.07.202	1.400	(3)	(3)	0,00
	Put - OTC 7-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,850	27.07.202	1.400	(3)	(5)	0,00
MYC	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,050	19.07.202	6.900	(41)	0	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,050	19.07.202	6.900	(41)	(153)	(0,01)
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,052	20.07.202	6.900	(42)	0	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,052	20.07.202	6.900	(42)	(152)	(0,01)
	Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,700	19.07.202	1.500	(35)	0	0,00
	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,700	19.07.202	1.500	(35)	(79)	(0,01)
	Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,675	20.07.202	1.500	(35)	0	0,00
	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,675	20.07.202	1.500	(35)	(81)	(0,01)
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,993	11.10.202	4.400	(30)	(1)	0,01
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,993	11.10.202	4.400	(30)	(93)	(0,01)
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,200	06.07.202	2.300	(7)	0	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,650	06.07.202	2.300	(7)	(2)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,300	10.07.202	4.000	(14)	(1)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,750	10.07.202	4.000	(14)	(3)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,270	24.07.202	2.200	(7)	(4)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,670	24.07.202	2.200	(7)	(9)	0,00
	Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,550	19.07.202	400	(29)	0	0,00
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,550	19.07.202	400	(29)	(47)	0,00
	Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,537	20.07.202	400	(29)	0	0,00
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,537	20.07.202	400	(29)	(48)	0,00
							$ (1.928)	$ (2.619)	(0,18)

ZINSCAPS

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag[1]	Aufgeld	Markt-wert	% des Nettovermögens
MYC	Call - OTC 1-Year Interest Rate Floor[2]	1-Year USD-LIBOR	0,030 %	24.07.2024	15.900	$ (119)	$ (350)	(0,02)
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Floor[2]	1-Year USD-LIBOR	0,030	24.07.2024	15.900	(119)	(4)	0,00
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Floor[2]	1-Year USD-LIBOR	0,026	23.07.2025	15.900	(139)	(254)	(0,02)
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Floor[2]	1-Year USD-LIBOR	0,026	23.07.2025	15.900	(139)	(36)	0,00
	Call - OTC 2-Year Interest Rate Floor[2]	2-Year USD-LIBOR	0,026	23.07.2026	11.300	(200)	(321)	(0,02)
	Put - OTC 2-Year Interest Rate Floor[2]	2-Year USD-LIBOR	0,026	23.07.2026	11.300	(200)	(75)	(0,01)
						$ (916)	$ (1.040)	(0,07)

(1) Der Nennbetrag stellt die Anzahl der Kontrakte dar.

(2) Das zugrunde liegende Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft.

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMMISSIONEN - SCHUTZVERKAUF[1]

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag[2]	Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Markt-wert	% des Nettovermögens
BOA	Turkey Government International Bond	1,000 %	20.12.2024	$ 100	$ (12)	$ 8	$ (4)	0,00
BPS	Colombia Government International Bond	1,000	20.12.2027	500	(45)	23	(22)	0,00
	Mexico Government International Bond	1,000	20.06.2024	100	(2)	3	1	0,00
BRC	Colombia Government International Bond	1,000	20.12.2026	900	(41)	22	(19)	0,00
	Turkey Government International Bond	1,000	20.12.2023	200	(13)	12	(1)	0,00
	Turkey Government International Bond	1,000	20.12.2024	640	(82)	57	(25)	0,00
CBK	Colombia Government International Bond	1,000	20.06.2027	400	(14)	2	(12)	0,00
	Mexico Government International Bond	1,000	20.06.2024	100	(2)	3	1	0,00
DUB	South Africa Government International Bond	1,000	20.12.2026	100	(4)	0	(4)	0,00
GST	Colombia Government International Bond	1,000	20.06.2027	500	(18)	3	(15)	0,00
	Colombia Government International Bond	1,000	20.12.2027	300	(27)	14	(13)	0,00
	South Africa Government International Bond	1,000	20.12.2025	200	(11)	8	(3)	0,00
	Turkey Government International Bond	1,000	20.12.2024	700	(79)	52	(27)	0,00
HUS	Brazil Government International Bond	1,000	20.12.2023	300	(10)	11	1	0,00
MYC	Colombia Government International Bond	1,000	20.06.2027	700	(27)	6	(21)	0,00
	Colombia Government International Bond	1,000	20.12.2027	800	(71)	36	(35)	(0,01)
	Mexico Government International Bond	1,000	20.12.2024	300	(2)	5	3	0,00
	Mexico Government International Bond	1,000	20.12.2025	200	(3)	6	3	0,00
	South Africa Government International Bond	1,000	20.12.2026	1.400	(62)	12	(50)	(0,01)
	Turkey Government International Bond	1,000	20.06.2024	100	(16)	14	(2)	0,00
					$ (541)	$ 297	$ (244)	(0,02)

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES - SCHUTZVERKAUF[1]

Kontrahent	Index/Tranchen	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag[2]	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Markt-wert	% des Nettovermögens
GST	CMBX.NA.AAA.13 Index	0,500 %	16.12.2072	$ 62.300	$ 92	$ (1.027)	$ (935)	(0,06)
MEI	CMBX.NA.AAA.12 Index	0,500	17.08.2061	15.300	(74)	(95)	(169)	(0,01)
MYC	CMBX.NA.AAA.10 Index	0,500	17.11.2059	25.375	(78)	(25)	(103)	(0,01)
	CMBX.NA.AAA.11 Index	0,500	18.11.2054	25.375	(193)	16	(177)	(0,01)
	CMBX.NA.AAA.12 Index	0,500	17.08.2061	300	(2)	(1)	(3)	0,00
	CMBX.NA.AAA.13 Index	0,500	16.12.2072	25.500	86	(469)	(383)	(0,03)
					$ (169)	$ (1.601)	$ (1.770)	(0,12)

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

(2) Der maximal mögliche Betrag, den der Fonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung		Zu erhaltende Währung		Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2023	KRW	223.531	$	171	$ 1	$ 0	$ 1	0,00
	07.2023	$	6.450	MXN	118.750	456	0	456	0,03
	08.2023	AUD	73	$	48	0	0	0	0,00
	08.2023	£	1.313		1.648	0	(21)	(21)	0,00
	08.2023	¥	1.058.165		7.674	292	0	292	0,02
	08.2023	$	11.982	AUD	17.725	0	(169)	(169)	(0,01)
	08.2023		1.034	€	959	14	0	14	0,00
	08.2023		1.506	NZD	2.375	0	(51)	(51)	0,00
	09.2023	¥	1.441.000	$	10.300	208	0	208	0,01
	09.2023	TWD	46.342		1.527	36	0	36	0,00
	09.2023	$	632	IDR	9.457.672	0	(4)	(4)	0,00
	09.2023		1.260	KRW	1.596.349	0	(43)	(43)	0,00
BPS	07.2023	KRW	33.984	$	26	0	0	0	0,00
	08.2023	CNH	541		78	4	0	4	0,00

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung		Zu erhaltende Währung		Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
	08.2023	KRW	2.227.911	$	1.699	$ 6	$ 0	$ 6	0,00
	08.2023	TWD	23.196		760	15	0	15	0,00
	08.2023	$	92	CNH	642	0	(4)	(4)	0,00
	08.2023		684	€	625	0	(1)	(1)	0,00
	08.2023		1.944	INR	159.719	1	0	1	0,00
	08.2023	ZAR	89.047	$	4.848	153	0	153	0,01
	09.2023	$	232	IDR	3.489.845	0	0	0	0,00
	10.2023	ZAR	47.252	$	2.539	64	0	64	0,00
BRC	07.2023	¥	285.000		2.203	228	0	228	0,02
	07.2023	KRW	224.770		172	1	0	1	0,00
	07.2023	$	1.265	BRL	6.050	0	(10)	(10)	0,00
	08.2023	£	18.058	$	22.665	0	(298)	(298)	(0,02)
	08.2023	$	173	CNH	1.196	0	(8)	(8)	0,00
	08.2023		3.833	¥	507.304	0	(301)	(301)	(0,02)
	08.2023	ZAR	4.892	$	265	7	0	7	0,00
	09.2023	IDR	18.085		1	0	0	0	0,00
	09.2023	¥	510.000		3.726	164	0	164	0,01
CBK	07.2023	BRL	5.713		1.191	6	0	6	0,00
	07.2023	PEN	357		98	0	0	0	0,00
	07.2023	$	92	PEN	357	7	0	7	0,00
	08.2023	AUD	79	$	53	0	0	0	0,00
	08.2023	€	1.137		1.244	1	0	1	0,00
	08.2023	¥	1.161.835		8.432	327	0	327	0,02
	08.2023	TWD	24.150		791	16	0	16	0,00
	08.2023	$	2.914	CLP	2.396.204	56	0	56	0,00
	08.2023		628	¥	83.400	0	(47)	(47)	0,00
	08.2023		2.462	NOK	25.677	0	(61)	(61)	0,00
	08.2023		558	ZAR	10.215	0	(20)	(20)	0,00
	09.2023	KRW	204.470	$	158	2	0	2	0,00
	09.2023	$	1.177	BRL	5.713	0	(6)	(6)	0,00
	09.2023		5	IDR	73.375	0	0	0	0,00
DUB	07.2023	PEN	357	$	98	0	(1)	(1)	0,00
	07.2023	$	9.827	BRL	53.244	1.212	0	1.212	0,08
	07.2023		196	PEN	715	1	0	1	0,00
	10.2023	ZAR	8.696	$	478	22	0	22	0,00
GLM	07.2023	BRL	106.402		22.036	0	(21)	(21)	0,00
	07.2023	KRW	88.882		68	0	0	0	0,00
	08.2023	CHF	2.864		3.236	21	0	21	0,00
	08.2023	KRW	1.061.378		807	0	0	0	0,00
	08.2023	$	2.997	INR	246.205	1	0	1	0,00
	08.2023		3.076	NOK	32.641	0	(25)	(25)	0,00
	09.2023	TWD	35.334	$	1.161	24	0	24	0,00
	09.2023	$	22.036	BRL	107.581	17	0	17	0,00
	09.2023		1.186	PEN	4.370	12	0	12	0,00
	10.2023	MXN	5.411	$	308	0	(1)	(1)	0,00
	10.2023	ZAR	9.925		530	10	0	10	0,00
MBC	07.2023	¥	330.000		2.527	237	0	237	0,02
	08.2023	CNH	378		55	3	0	3	0,00
	08.2023	€	147.971		163.283	1.513	0	1.513	0,10
	08.2023	$	742	CHF	663	2	0	2	0,00
	08.2023		1.343	€	1.225	0	(4)	(4)	0,00
	09.2023	¥	1.863.000	$	13.571	546	0	546	0,04
	09.2023	$	2.320	KRW	2.959.169	0	(65)	(65)	(0,01)
MYI	07.2023	€	86	$	93	0	0	0	0,00
	07.2023	IDR	2.493.164		167	0	0	0	0,00
	07.2023	$	547	£	433	4	0	4	0,00
	07.2023		166	IDR	2.493.164	0	0	0	0,00
	08.2023	TWD	25.051	$	826	22	0	22	0,00
	08.2023	$	779	€	719	7	0	7	0,00
	08.2023		8.203	¥	1.090.123	0	(614)	(614)	(0,04)
	08.2023	ZAR	6.258	$	323	0	(7)	(7)	0,00
	09.2023	KRW	1.098.743		846	9	0	9	0,00
	09.2023	$	539	IDR	8.059.149	0	(4)	(4)	0,00
	09.2023		2.599	KRW	3.325.627	0	(64)	(64)	0,00
RBC	07.2023		1	MXN	23	0	0	0	0,00
	08.2023	£	38.516	$	48.665	0	(315)	(315)	(0,02)
	08.2023	$	2.139	CHF	1.914	10	0	10	0,00
	08.2023		880	MXN	15.242	2	0	2	0,00
SCX	08.2023	CNH	637	$	93	5	0	5	0,00
	08.2023	NZD	3.092		1.879	0	(15)	(15)	0,00
	08.2023	$	1.161	NOK	12.340	0	(7)	(7)	0,00
	08.2023		526	NZD	843	0	(10)	(10)	0,00
	09.2023	KRW	201.646	$	156	2	0	2	0,00
	09.2023	TWD	38.723		1.270	24	0	24	0,00
	09.2023	$	5.578	IDR	83.020.457	0	(63)	(63)	0,00
SSB	07.2023	¥	120.000	$	910	76	0	76	0,01
	07.2023	KRW	164.720		126	1	0	1	0,00
	07.2023	$	10.516	BRL	52.821	434	0	434	0,03
	12.2023		166	INR	13.701	0	0	0	0,00
UAG	08.2023	£	38.597	$	48.785	0	(296)	(296)	(0,02)
	08.2023	$	790	CHF	712	9	0	9	0,00
	08.2023		7.881	£	6.228	39	0	39	0,00
	08.2023	ZAR	33.736	$	1.757	1	(22)	(21)	0,00

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung		Zu erhaltende Währung		Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
	09.2023	SGD	191	$	143	$ 1	$ 0	$ 1	0,00
	09.2023	ZAR	15.714		896	70	0	70	0,00
						$ 6.402	$ (2.578)	$ 3.824	0,26

ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklassen Institutional EUR (Hedged) thesaurierend, Institutional EUR (Hedged) ausschüttend, Class E EUR (Hedged) thesaurierend, Class E EUR (Hedged) ausschüttend und Class Z EUR (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung		Zu erhaltende Währung		Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2023	€	18	$	20	$ 0	$ 0	$ 0	0,00
	07.2023	$	248.660	€	231.375	3.770	0	3.770	0,26
BPS	07.2023	€	234.220	$	256.635	1.101	0	1.101	0,08
	07.2023	$	250.174	€	232.693	3.693	0	3.693	0,25
	08.2023		256.956		234.184	0	(1.111)	(1.111)	(0,08)
CBK	07.2023	€	236.181	$	256.765	0	(909)	(909)	(0,06)
	07.2023	$	697	€	641	3	(1)	2	0,00
	08.2023		256.018		235.152	884	0	884	0,06
MBC	07.2023	€	191	$	205	0	(4)	(4)	0,00
	07.2023	$	3.712	€	3.455	59	(2)	57	0,01
SCX	07.2023		249.465		233.109	4.857	0	4.857	0,33
						$ 14.367	$ (2.027)	$ 12.340	0,85

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklassen Institutional GBP (Hedged) thesaurierend und Institutional GBP (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung		Zu erhaltende Währung		Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BPS	07.2023	$	105.036	£	84.920	$ 2.927	$ 0	$ 2.927	0,20
BRC	07.2023		75.791		59.524	0	(115)	(115)	(0,01)
CBK	07.2023	£	1.700	$	2.150	0	(11)	(11)	0,00
	07.2023	$	54	£	43	0	0	0	0,00
MBC	07.2023		105.325		85.082	2.844	0	2.844	0,20
MYI	07.2023		104.636		84.189	2.398	0	2.398	0,16
						$ 8.169	$ (126)	$ 8.043	0,55

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklasse Institutional SGD (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung		Zu erhaltende Währung		Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BRC	07.2023	$	3.561	SGD	4.819	$ 0	$ (1)	$ (1)	0,00
GLM	07.2023	SGD	129	$	95	1	0	1	0,00
	07.2023	$	585	SGD	784	0	(5)	(5)	0,00
MBC	07.2023		3.252		4.394	0	(5)	(5)	0,00
	08.2023		4		5	0	0	0	0,00
MYI	07.2023	SGD	5.215	$	3.860	6	0	6	0,00
	08.2023	$	3.860	SGD	5.210	0	(6)	(6)	0,00
SCX	07.2023		387		523	0	0	0	0,00
UAG	07.2023	SGD	9	$	7	0	0	0	0,00
	07.2023	$	4.396	SGD	5.936	0	(10)	(10)	0,00
						$ 7	$ (27)	$ (20)	0,00

Summe Freiverkehrsfinanzderivate	**$ 20.660**	**1,42**
Summe Anlagen	**$ 2.218.704**	**152,45**
Sonstige Aktiva und Passiva	**$ (763.319)**	**(52,45)**
Nettovermögen	**$ 1.455.385**	**100,00**

ERLÄUTERUNGEN ZUR AUFSTELLUNG DES WERTPAPIERBESTANDS (Angaben in Tausend*):

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

^ **Das Wertpapier ist in Verzug.**

(a) **Bei dem Wertpapier handelt es sich um ein Interest Only- („IO“) bzw. IO-Strip.**

(b) **Wertpapier per Emissionstermin.**

(c) **Wertpapier mit Sachwertausschüttung.**

(d) **Das Wertpapier hat in den letzten zwölf Monaten keine Erträge geliefert.**

(e) **Nullkuponwertpapier.**

(f) **Der Kupon stellt eine Rendite bis zur Endfälligkeit dar.**

(g) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

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

(i) Mit dem Fonds verbunden.

(j) Bedingt wandelbares Wertpapier.

(k) Eingeschränkte Wertpapiere (31. Dezember 2022: 0,77 %):

Emittentenbeschreibung	Kaufdatum	Kosten	Marktwert	% des Nettovermögens
Intelsat Emergence S.A.	05.09.2018 - 23.02.2022	$ 3.227	$ 1.046	0,07
Neiman Marcus Group Ltd. LLC	25.09.2020	166	782	0,05
Westmoreland Mining Holdings LLC	26.03.2019	1	1	0,00
		$ 3.394	1.829	0,12

Barmittel in Höhe von 36.784 USD (31. Dezember 2022: 28.338 USD) wurden zum 30. Juni 2023 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Barmittel in Höhe von 4.353 USD (31. Dezember 2022: 9.984 USD) wurden zum 30. Juni 2023 gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. als Sicherheit für Finanzderivate verpfändet.

Beizulegender Zeitwert[1]

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 30. Juni 2023 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie[2]	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	$ 480	$ 1.699.324	$ 8.224	$ 1.708.028
Investmentfonds	145.966	0	0	145.966
Pensionsgeschäfte	0	326.492	0	326.492
Finanzderivate[3]	73	38.145	0	38.218
Summen	**$ 146.519**	**$ 2.063.961**	**$ 8.224**	**$ 2.218.704**

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

Kategorie[2]	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	$ 1.018	$ 1.197.881	$ 14.709	$ 1.213.608
Investmentfonds	106.140	0	0	106.140
Pensionsgeschäfte	0	98.831	0	98.831
Finanzderivate[3]	579	14.698	0	15.277
Leerverkaufte Wertpapiere	0	(5.209)	0	(5.209)
Summen	**$ 107.737**	**$ 1.306.201**	**$ 14.709**	**$ 1.428.647**

(1) Weitere Informationen finden Sie in den Erläuterungen in Erläuterung 3.

(2) Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung des Wertpapierbestands.

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

Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC-Finanzderivate und -Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2023 und 31. Dezember 2022:

	Zum 30. Jun. 2023			Zum 31. Dez. 2022		
Kontrahent	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Nettoengagement[1]	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Nettoengagement[1]
AZD	$ k. A.	$ k. A.	$ k. A.	$ (35)	$ 0	$ (35)
BOA	4.367	(3.450)	917	(2.834)	2.820	(14)
BPS	6.825	(5.480)	1.345	(1.952)	1.730	(222)
BRC	(394)	750	356	(307)	301	(6)
CBK	195	0	195	6.696	(6.666)	30
DUB	1.066	(1.170)	(104)	(582)	370	(212)
GLM	(1.123)	996	(127)	(2.097)	2.036	(61)
GST	(993)	1.154	161	(885)	904	19
HUS	1	0	1	1	0	1
MBC	5.124	(4.570)	554	4.371	(3.930)	441
MEI	(169)	280	111	(56)	260	204
MYC	(783)	1.173	390	(562)	813	251
MYI	1.751	(1.090)	661	(223)	270	47
RBC	(303)	0	(303)	(39)	0	(39)
SAL	k. A.	k. A.	k. A.	(49)	0	(49)
SCX	4.793	(4.320)	473	6.363	(5.950)	413
SSB	511	(570)	(59)	16	0	16
UAG	(208)	0	(208)	(687)	480	(207)

(1) Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären.

Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung des Wertpapierbestands zum 30. Juni 2023:

	30. Jun. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	50,04	35,07
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	67,31	75,51
Sonstige übertragbare Wertpapiere	0,01	1,33
Investmentfonds	10,03	9,79
Pensionsgeschäfte	22,43	9,11
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	0,15	0,19
Zentral abgerechnete Finanzderivate	1,06	0,57
Freiverkehrsfinanzderivate	1,42	0,66
Leerverkaufte Wertpapiere	k. A.	(0,48)

Das Anlageportfolio des Fonds konzentriert sich zum 30. Juni 2023 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	30. Jun. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
Kreditbeteiligungen und -abtretung	2,27	6,41
Unternehmensanleihen und Wechsel	14,95	26,11
Wandelanleihen & Wechsel	0,04	0,05
US-Regierungsbehörden	53,28	33,41
US-Schatzobligationen	10,20	9,02
Non-Agency-MBS	21,96	19,47
Forderungsbesicherte Wertpapiere	7,78	8,93
Staatsemissionen	1,57	3,00
Stammaktien	0,17	0,29
Bezugsrechte	0,00	0,01
Optionsscheine	0,00	0,00
Real Estate Investment Trusts	0,00	0,00
Kurzfristige Instrumente	5,14	5,21
Investmentfonds	10,03	9,79
Pensionsgeschäfte	22,43	9,11
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	0,22	0,20
Verkaufsoptionen		
Optionen auf börsengehandelte Terminkontrakte	(0,07)	(0,01)
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	0,03	0,00
Credit Default Swaps auf Kreditindizes— Schutzverkauf	0,14	0,00
Zinsswaps	0,89	0,57
Freiverkehrsfinanzderivate		
Optionskauf		
Zinsswapoptionen	0,15	0,19
Verkaufsoptionen		
Credit Default Swaptions auf Kreditindizes	k. A.	0,00
Zinsswapoptionen	(0,18)	(0,32)
Zinscaps	(0,07)	(0,08)
Optionen auf Wertpapiere	k. A.	(0,01)
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	(0,02)	(0,04)
Credit Default Swaps auf Kreditindizes— Schutzverkauf	(0,12)	(0,13)
Total Return Swaps auf Indizes	k. A.	0,00
Devisenterminkontrakte	0,26	(0,55)
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	1,40	1,60
Leerverkaufte Wertpapiere	k. A.	(0,48)
Sonstige Aktiva und Passiva	(52,45)	(31,75)
Nettovermögen	100,00	100,00

Aufstellung des Wertpapierbestands des Low Duration Opportunities Fund

BESCHREIBUNG		PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE				
KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG				
American Airlines, Inc.				
10,000 % fällig am 20.04.2028	$	1.100	$ 1.125	0,10
IRB Holding Corp.				
8,202 % fällig am 15.12.2027		4.840	4.812	0,43
MPH Acquisition Holdings LLC				
9,726 % fällig am 01.09.2028		3.832	3.435	0,31
RegionalCare Hospital Partners Holdings, Inc.				
9,023 % fällig am 16.11.2025		1.215	1.128	0,10
			10.500	0,94
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
BANKEN UND FINANZEN				
Acef Holding S.C.A.				
1,250 % fällig am 26.04.2030	€	1.000	836	0,07
AGFC Capital Trust				
7,010 % fällig am 15.01.2067	$	500	270	0,02
Aircastle Ltd.				
2,850 % fällig am 26.01.2028		1.500	1.277	0,11
AMCO - Asset Management Co. SpA				
1,500 % fällig am 17.07.2023	€	505	551	0,05
2,250 % fällig am 17.07.2027		2.900	2.874	0,26
American Assets Trust LP				
3,375 % fällig am 01.02.2031	$	2.050	1.606	0,14
American Tower Corp.				
4,400 % fällig am 15.02.2026		850	824	0,07
5,250 % fällig am 15.07.2028		2.000	1.979	0,18
Aroundtown S.A.				
5,375 % fällig am 21.03.2029		3.100	2.297	0,20
Avolon Holdings Funding Ltd.				
2,528 % fällig am 18.11.2027		1.806	1.525	0,14
Balder Finland Oyj				
1,000 % fällig am 18.01.2027	€	1.900	1.563	0,14
1,000 % fällig am 20.01.2029		500	348	0,03
Banca Monte dei Paschi di Siena SpA				
7,677 % fällig am 18.01.2028		3.800	3.493	0,31
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A.				
5,875 % fällig am 24.09.2023 (f)(h)		1.000	1.082	0,10
Banco de Credito del Peru S.A.				
4,650 % fällig am 17.09.2024	PEN	7.000	1.852	0,17
Bank of America Corp.				
3,384 % fällig am 02.04.2026	$	2.300	2.206	0,20
3,864 % fällig am 23.07.2024		1.800	1.798	0,16
4,376 % fällig am 27.04.2028		1.000	961	0,09
Banque Federative du Credit Mutuel S.A.				
1,250 % fällig am 05.12.2025	£	1.200	1.340	0,12
Barclays PLC				
3,125 % fällig am 17.01.2024		100	125	0,01
4,375 % fällig am 12.01.2026	$	1.700	1.634	0,15
4,972 % fällig am 16.05.2029		800	757	0,07
5,746 % fällig am 09.08.2033		100	97	0,01
7,125 % fällig am 15.06.2025 (f)(h)	£	1.800	2.081	0,19
BNP Paribas S.A.				
1,875 % fällig am 14.12.2027		1.900	1.971	0,18
1,904 % fällig am 30.09.2028	$	3.400	2.900	0,26
BPCE S.A.				
1,500 % fällig am 13.01.2042 (h)	€	1.800	1.656	0,15
4,625 % fällig am 12.09.2028	$	2.500	2.346	0,21
Canadian Imperial Bank of Commerce				
3,250 % fällig am 31.03.2027	€	3.200	3.428	0,31
CapitaLand Ascendas REIT				
0,750 % fällig am 23.06.2028		1.100	960	0,09
CBRE Global Investors Open-Ended Fund S.C.A. SICAV-SIF Pan European Core Fund				
0,500 % fällig am 27.01.2028		1.600	1.381	0,12
0,900 % fällig am 12.10.2029		1.600	1.278	0,11
Cooperatieve Rabobank UA				
3,100 % fällig am 29.06.2028 (f)(h)		3.800	3.233	0,29
CPI Property Group S.A.				
1,750 % fällig am 14.01.2030		3.000	1.987	0,18
2,750 % fällig am 22.01.2028	£	700	596	0,05
Credit Suisse AG				
0,250 % fällig am 01.09.2028	€	3.000	2.630	0,23
6,500 % fällig am 08.08.2023 (h)	$	4.100	4.085	0,36
Credit Suisse Group AG ^	$	7.900	$ 316	0,03
Cromwell Ereit Lux Finco SARL				
2,125 % fällig am 19.11.2025	€	2.000	1.883	0,17
CTP NV				
0,625 % fällig am 27.09.2026		2.700	2.382	0,21
1,500 % fällig am 27.09.2031		2.500	1.904	0,17
Deutsche Bank AG				
1,625 % fällig am 20.01.2027		2.000	1.940	0,17
2,625 % fällig am 16.12.2024	£	3.000	3.550	0,32
3,729 % fällig am 14.01.2032 (i)	$	2.200	1.665	0,15
DVI Deutsche Vermögens- & Immobilienverwaltungs GmbH				
2,500 % fällig am 25.01.2027	€	2.100	1.740	0,16
Fairfax Financial Holdings Ltd.				
4,625 % fällig am 29.04.2030	$	700	657	0,06
Ford Motor Credit Co. LLC				
1,744 % fällig am 19.07.2024	€	2.900	3.063	0,27
2,900 % fällig am 16.02.2028	$	900	772	0,07
3,021 % fällig am 06.03.2024	€	100	108	0,01
3,250 % fällig am 15.09.2025		200	210	0,02
3,375 % fällig am 13.11.2025	$	600	558	0,05
Goldman Sachs Group, Inc.				
3,691 % fällig am 05.06.2028		100	94	0,01
4,223 % fällig am 01.05.2029		2.500	2.363	0,21
HSBC Holdings PLC				
5,750 % fällig am 20.12.2027	£	100	121	0,01
6,000 % fällig am 29.03.2040		200	223	0,02
6,254 % fällig am 09.03.2034	$	2.100	2.154	0,19
Huarong Finance Co. Ltd.				
3,375 % fällig am 24.02.2030		800	607	0,05
3,625 % fällig am 30.09.2030		1.500	1.139	0,10
4,250 % fällig am 07.11.2027		200	167	0,01
4,500 % fällig am 29.05.2029		1.400	1.123	0,10
4,750 % fällig am 27.04.2027		1.000	866	0,08
ING Groep NV				
1,726 % fällig am 01.04.2027		3.000	2.674	0,24
Intesa Sanpaolo SpA				
7,750 % fällig am 11.01.2027 (f)(h)	€	1.700	1.796	0,16
JPMorgan Chase & Co.				
1,963 % fällig am 23.03.2030		1.000	964	0,09
Kennedy Wilson Europe Real Estate Ltd.				
3,250 % fällig am 12.11.2025		2.900	2.808	0,25
LeasePlan Corp. NV				
2,875 % fällig am 24.10.2024	$	1.200	1.144	0,10
Legal & General Group PLC				
5,625 % fällig am 24.03.2031 (f)(h)	£	600	590	0,05
Lloyds Banking Group PLC				
2,250 % fällig am 16.10.2024		900	1.083	0,10
3,750 % fällig am 11.01.2027	$	2.500	2.344	0,21
3,750 % fällig am 18.03.2028		1.000	924	0,08
4,375 % fällig am 22.03.2028		400	380	0,03
4,716 % fällig am 11.08.2026		3.000	2.916	0,26
Logicor Financing SARL				
0,625 % fällig am 17.11.2025	€	1.300	1.244	0,11
1,500 % fällig am 13.07.2026		1.000	943	0,08
3,250 % fällig am 13.11.2028		700	654	0,06
Midcap Financial Issuer Trust				
5,625 % fällig am 15.01.2030	$	200	159	0,01
Mitsubishi HC Capital, Inc.				
3,960 % fällig am 19.09.2023		1.600	1.592	0,14
Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc.				
0,339 % fällig am 19.07.2024	€	1.600	1.679	0,15
5,242 % fällig am 19.04.2029	$	600	591	0,05
Mizuho Financial Group, Inc.				
3,477 % fällig am 12.04.2026		3.050	2.889	0,26
NatWest Group PLC				
2,000 % fällig am 04.03.2025	€	2.300	2.463	0,22
4,800 % fällig am 05.04.2026	$	700	680	0,06
4,892 % fällig am 18.05.2029		700	667	0,06
8,000 % fällig am 10.08.2025 (f)(h)		300	292	0,03
NE Property BV				
1,875 % fällig am 09.10.2026	€	1.500	1.421	0,13
2,000 % fällig am 20.01.2030		3.100	2.503	0,22
Nissan Motor Acceptance Co. LLC				
2,450 % fällig am 15.09.2028	$	800	639	0,06
Nova Kreditna Banka Maribor d.d.				
1,875 % fällig am 27.01.2025	€	2.200	2.322	0,21
Nova Ljubljanska Banka d.d.				
3,400 % fällig am 05.02.2030	€	2.400	$ 2.226	0,20
3,650 % fällig am 19.11.2029		1.400	1.298	0,12
Peugeot Invest				
1,875 % fällig am 30.10.2026		3.800	3.778	0,34
Piper Sandler Cos.				
5,200 % fällig am 15.10.2023	$	1.600	1.596	0,14
Protective Life Global Funding				
3,104 % fällig am 15.04.2024		5.000	4.894	0,44
Rexford Industrial Realty LP				
2,150 % fällig am 01.09.2031		21	16	0,00
Sagax AB				
1,125 % fällig am 30.01.2027	€	1.700	1.565	0,14
Sagax Euro MTN NL BV				
0,750 % fällig am 26.01.2028		600	497	0,04
1,000 % fällig am 17.05.2029		1.000	778	0,07
Santander Holdings USA, Inc.				
3,244 % fällig am 05.10.2026	$	100	90	0,01
Santander UK Group Holdings PLC				
3,625 % fällig am 14.01.2026	£	300	349	0,03
3,823 % fällig am 03.11.2028	$	300	270	0,02
4,796 % fällig am 15.11.2024		4.000	3.970	0,35
Sirius Real Estate Ltd.				
1,125 % fällig am 22.06.2026	€	1.100	992	0,09
Sofina S.A.				
1,000 % fällig am 23.09.2028		2.500	2.184	0,19
Standard Chartered PLC				
1,214 % fällig am 23.03.2025	$	1.500	1.443	0,13
Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd.				
2,550 % fällig am 10.03.2025		2.400	2.268	0,20
3,629 % fällig am 06.04.2026	€	2.600	2.802	0,25
Sun Communities Operating LP				
4,200 % fällig am 15.04.2032	$	2.500	2.186	0,20
Toronto-Dominion Bank				
3,879 % fällig am 13.03.2026	€	8.000	8.716	0,78
TP ICAP Finance PLC				
2,625 % fällig am 18.11.2028	£	1.000	940	0,08
5,250 % fällig am 29.05.2026		1.400	1.640	0,15
UBS AG				
5,125 % fällig am 15.05.2024 (h)	$	100	98	0,01
UBS Group AG				
1,000 % fällig am 24.06.2027	€	500	484	0,04
2,125 % fällig am 12.09.2025	£	200	238	0,02
2,125 % fällig am 15.11.2029		2.400	2.387	0,21
3,091 % fällig am 14.05.2032	$	3.500	2.833	0,25
3,750 % fällig am 26.03.2025		150	144	0,01
4,194 % fällig am 01.04.2031		800	712	0,06
4,550 % fällig am 17.04.2026		1.000	962	0,09
UniCredit SpA				
7,500 % fällig am 03.06.2026 (f)(h)	€	1.200	1.289	0,12
7,830 % fällig am 04.12.2023	$	500	503	0,04
VICI Properties LP				
4,375 % fällig am 15.05.2025		1.300	1.258	0,11
Volkswagen Financial Services NV				
1,625 % fällig am 10.02.2024	£	1.100	1.359	0,12
1,875 % fällig am 03.12.2024		2.000	2.378	0,21
Wells Fargo & Co.				
4,808 % fällig am 25.07.2028	$	2.000	1.957	0,17
			190.893	17,02
INDUSTRIEWERTE				
Aeroporti di Roma SpA				
1,750 % fällig am 30.07.2031	€	600	532	0,05
Air Canada				
3,875 % fällig am 15.08.2026	$	1.200	1.113	0,10
Alaska Airlines Pass-Through Trust				
4,800 % fällig am 15.02.2029		1.688	1.624	0,14
Altice France S.A.				
4,250 % fällig am 15.10.2029	€	2.000	1.576	0,14
5,500 % fällig am 15.10.2029	$	2.100	1.504	0,13
AMC Networks, Inc.				
4,750 % fällig am 01.08.2025		100	88	0,01
American Airlines Pass-Through Trust				
3,150 % fällig am 15.08.2033		586	512	0,05
3,250 % fällig am 15.04.2030		17	15	0,00

BESCHREIBUNG		PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
3,375 % fällig am 01.11.2028	$	1.021	$ 917	0,08
3,650 % fällig am 15.08.2030		710	655	0,06
3,700 % fällig am 01.04.2028		221	199	0,02
American Airlines, Inc.				
5,500 % fällig am 20.04.2026		2.900	2.876	0,26
American Medical Systems Europe BV				
1,375 % fällig am 08.03.2028	€	2.000	1.966	0,17
Boeing Co.				
2,750 % fällig am 01.02.2026	$	2.100	1.956	0,17
British Airways Pass-Through Trust				
3,300 % fällig am 15.06.2034		86	75	0,01
4,250 % fällig am 15.05.2034		311	284	0,03
Broadcom, Inc.				
3,469 % fällig am 15.04.2034		200	164	0,01
Chanel Ceres PLC				
0,500 % fällig am 31.07.2026	€	1.300	1.264	0,11
1,000 % fällig am 31.07.2031		2.100	1.830	0,16
Cheniere Corpus Christi Holdings LLC				
5,875 % fällig am 31.03.2025	$	20	20	0,00
Constellation Oil Services Holding S.A. (3,000 % bar und 4,000 % PIK)				
3,000 % fällig am 31.12.2026 (a)		562	332	0,03
DAE Funding LLC				
1,625 % fällig am 15.02.2024		700	675	0,06
3,375 % fällig am 20.03.2028		3.300	2.978	0,27
Delta Air Lines, Inc.				
7,000 % fällig am 01.05.2025		800	818	0,07
Discovery Communications LLC				
2,500 % fällig am 20.09.2024	£	100	121	0,01
Enbridge, Inc.				
5,700 % fällig am 08.03.2033	$	2.000	2.028	0,18
Exela Intermediate LLC				
11,500 % fällig am 15.07.2026		218	21	0,00
Expedia Group, Inc.				
2,950 % fällig am 15.03.2031		540	456	0,04
6,250 % fällig am 01.05.2025		527	529	0,05
GE Capital UK Funding Unlimited Co.				
5,875 % fällig am 18.01.2033	£	300	369	0,03
Greene King Finance PLC				
5,318 % fällig am 15.09.2031		331	379	0,03
6,801 % fällig am 15.12.2034		100	96	0,01
Haleon U.S. Capital LLC				
3,375 % fällig am 24.03.2027	$	1.000	936	0,08
Haleon UK Capital PLC				
3,125 % fällig am 24.03.2025		2.000	1.912	0,17
Humana, Inc.				
3,700 % fällig am 23.03.2029		2.000	1.833	0,16
Hyatt Hotels Corp.				
1,800 % fällig am 01.10.2024		900	857	0,08
Informa PLC				
1,250 % fällig am 22.04.2028	€	1.500	1.422	0,13
1,500 % fällig am 05.07.2023		237	258	0,02
InterContinental Hotels Group PLC				
2,125 % fällig am 24.08.2026	£	200	220	0,02
2,125 % fällig am 15.05.2027	€	700	709	0,06
John Lewis PLC				
4,250 % fällig am 18.12.2034	£	1.300	1.031	0,09
6,125 % fällig am 21.01.2025		350	429	0,04
Melco Resorts Finance Ltd.				
5,750 % fällig am 21.07.2028	$	200	177	0,02
MGM China Holdings Ltd.				
5,250 % fällig am 18.06.2025		200	192	0,02
5,875 % fällig am 15.05.2026		200	191	0,02
Mileage Plus Holdings LLC				
6,500 % fällig am 20.06.2027		92	92	0,01
Mitchells & Butlers Finance PLC				
6,002 % fällig am 15.12.2030		117	107	0,01
6,013 % fällig am 15.12.2030	£	1.395	1.594	0,14
6,469 % fällig am 15.09.2032		400	444	0,04
Mundys SpA				
1,875 % fällig am 12.02.2028	€	3.900	3.638	0,32
Nissan Motor Co. Ltd.				
4,345 % fällig am 17.09.2027	$	2.000	1.820	0,16
Penske Truck Leasing Co. LP				
3,950 % fällig am 10.03.2025		800	769	0,07

BESCHREIBUNG		PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
Prosus NV				
1,207 % fällig am 19.01.2026	€	1.000	$ 994	0,09
2,085 % fällig am 19.01.2030		1.300	1.112	0,10
Sabine Pass Liquefaction LLC				
5,000 % fällig am 15.03.2027	$	500	492	0,04
5,750 % fällig am 15.05.2024		200	200	0,02
5,875 % fällig am 30.06.2026		1.000	1.009	0,09
Sands China Ltd.				
2,800 % fällig am 08.03.2027		200	174	0,02
Sasol Financing USA LLC				
5,875 % fällig am 27.03.2024		5.200	5.137	0,46
Scripps Escrow, Inc.				
3,875 % fällig am 15.01.2029		1.000	808	0,07
Southern Co.				
3,700 % fällig am 30.04.2030		800	734	0,07
Spirit AeroSystems, Inc.				
4,600 % fällig am 15.06.2028		1.100	924	0,08
Studio City Finance Ltd.				
5,000 % fällig am 15.01.2029		1.400	1.039	0,09
6,000 % fällig am 15.07.2025		200	186	0,02
Targa Resources Corp.				
4,200 % fällig am 01.02.2033		800	709	0,06
Tesco Corporate Treasury Services PLC				
0,375 % fällig am 27.07.2029	€	900	789	0,07
0,875 % fällig am 29.05.2026		2.000	1.993	0,18
U.S. Airways Pass-Through Trust				
3,950 % fällig am 15.05.2027	$	164	153	0,01
Ubisoft Entertainment S.A.				
0,878 % fällig am 24.11.2027	€	1.000	839	0,07
Unigel Luxembourg S.A.				
8,750 % fällig am 01.10.2026	$	200	66	0,01
United Airlines Pass-Through Trust				
2,700 % fällig am 01.11.2033		1.031	866	0,08
United Airlines, Inc.				
4,375 % fällig am 15.04.2026		800	761	0,07
4,625 % fällig am 15.04.2029		400	365	0,03
Venture Global Calcasieu Pass LLC				
3,875 % fällig am 01.11.2033		5.000	4.101	0,37
ViaSat, Inc.				
5,625 % fällig am 15.09.2025		300	291	0,03
Virgin Media Secured Finance PLC				
4,250 % fällig am 15.01.2030	£	1.800	1.806	0,16
Vmed O2 UK Financing PLC				
4,500 % fällig am 15.07.2031		700	677	0,06
Wynn Macau Ltd.				
5,500 % fällig am 01.10.2027	$	200	178	0,02
5,625 % fällig am 26.08.2028		1.100	961	0,09
			73.967	6,60
VERSORGUNGSUNTERNEHMEN				
AES Corp.				
2,450 % fällig am 15.01.2031		3.000	2.427	0,22
5,450 % fällig am 01.06.2028		2.000	1.966	0,18
Duke Energy Progress LLC				
5,250 % fällig am 15.03.2033		2.000	2.033	0,18
Electricite de France S.A.				
3,000 % fällig am 03.09.2027 (f)	€	800	741	0,07
Georgia Power Co.				
2,100 % fällig am 30.07.2023	$	3.080	3.071	0,27
Pacific Gas & Electric Co.				
1,700 % fällig am 15.11.2023		400	393	0,03
2,100 % fällig am 01.08.2027		1.900	1.624	0,14
3,150 % fällig am 01.01.2026		1.300	1.207	0,11
3,450 % fällig am 01.07.2025		200	189	0,02
3,500 % fällig am 15.06.2025 ^		600	568	0,05
3,950 % fällig am 01.12.2047 ^		200	137	0,01
4,000 % fällig am 01.12.2046 ^		300	202	0,02
4,550 % fällig am 01.07.2030		3.500	3.170	0,28
Sprint LLC				
7,625 % fällig am 01.03.2026		800	832	0,07
System Energy Resources, Inc.				
2,140 % fällig am 09.12.2025		700	635	0,06
Virginia Electric and Power Co.				
3,750 % fällig am 15.05.2027		2.900	2.779	0,25
			21.974	1,96
Summe Unternehmensanleihen und Wechsel			286.834	25,58

BESCHREIBUNG		PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
KOMMUNALANLEIHEN UND WECHSEL				
Golden State, California Tobacco Securitization Corp. Revenue Bonds, Series 2021				
3,487 % fällig am 01.06.2036	$	1.300	$ 1.064	0,10
Golden State, California Tobacco Securitization Corp. Revenue Bonds, (ST APPROP Insured), Series 2021				
3,000 % fällig am 01.06.2046		395	364	0,03
Golden State, California Tobacco Securitization Corp. Revenue Notes, Series 2021				
2,587 % fällig am 01.06.2029		4.000	3.423	0,31
Tobacco Settlement Finance Authority, West Virginia Revenue Bonds, Series 2007				
0,000 % fällig am 01.06.2047 (c)		4.700	444	0,04
Tobacco Settlement Finance Authority, West Virginia Revenue Bonds, Series 2020				
3,151 % fällig am 01.06.2032		200	166	0,01
3,401 % fällig am 01.06.2034		1.150	940	0,08
3,501 % fällig am 01.06.2035		1.700	1.375	0,12
			7.776	0,69
US-REGIERUNGSBEHÖRDEN				
Ginnie Mae				
3,500 % fällig am 15.07.2045		17.402	16.271	1,45
Ginnie Mae, TBA				
2,500 % fällig am 01.08.2053		7.100	6.154	0,55
Uniform Mortgage-Backed Security				
3,500 % fällig am 01.12.2047 - 01.07.2048		12.367	11.421	1,02
Uniform Mortgage-Backed Security, TBA				
3,000 % fällig am 01.08.2053		19.000	16.749	1,49
3,500 % fällig am 01.07.2053		64.100	58.477	5,21
4,000 % fällig am 01.08.2053		12.000	11.272	1,01
4,500 % fällig am 01.08.2053		19.400	18.662	1,66
5,000 % fällig am 01.08.2053		72.300	70.860	6,32
			209.866	18,71
US-SCHATZOBLIGATIONEN				
U.S. Treasury Bonds				
1,875 % fällig am 15.02.2041		15.600	11.341	1,01
U.S. Treasury Inflation Protected Securities (e)				
2,500 % fällig am 15.01.2029		42	44	0,00
U.S. Treasury Notes				
0,250 % fällig am 30.09.2025		24.400	22.105	1,97
0,375 % fällig am 30.11.2025		15.600	14.085	1,26
1,250 % fällig am 31.08.2024		37.300	35.584	3,17
1,750 % fällig am 30.06.2024		21.600	20.834	1,86
1,875 % fällig am 31.08.2024		650	625	0,05
2,125 % fällig am 31.03.2024		610	596	0,05
2,125 % fällig am 30.09.2024		87.000	83.678	7,46
2,125 % fällig am 30.11.2024		520	498	0,04
2,250 % fällig am 15.11.2024		3.340	3.208	0,29
2,375 % fällig am 15.08.2024		550	532	0,05
2,500 % fällig am 31.01.2024		870	856	0,08
2,875 % fällig am 30.11.2023		750	742	0,07
			194.728	17,36
NON-AGENCY-MBS				
Adjustable Rate Mortgage Trust				
3,839 % fällig am 25.11.2035 ^		272	206	0,02
American Home Mortgage Investment Trust				
5,730 % fällig am 25.11.2045		1.373	1.213	0,11
Atlas Funding PLC				
5,432 % fällig am 25.07.2058	£	778	989	0,09
Banc of America Funding Trust				
5,477 % fällig am 20.02.2047	$	636	656	0,06
5,537 % fällig am 20.07.2036		1.039	1.010	0,09
6,412 % fällig am 25.10.2036 ^		8	7	0,00
Barley Hill PLC				
5,824 % fällig am 27.08.2058	£	2.638	3.334	0,30
BCAP LLC Trust				
3,333 % fällig am 26.11.2036	$	304	293	0,03
5,510 % fällig am 25.03.2037		54	48	0,00
Bear Stearns Adjustable Rate Mortgage Trust				
4,517 % fällig am 25.01.2035		13	13	0,00
6,800 % fällig am 25.02.2036		10	10	0,00
Bear Stearns ALT-A Trust				
3,634 % fällig am 25.09.2035 ^		83	36	0,00

BESCHREIBUNG		PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
Brass PLC				
5,430 % fällig am 16.11.2066	£	1.336	$ 1.703	0,15
6,018 % fällig am 16.11.2066	$	152	152	0,01
Charter Mortgage Funding PLC				
5,327 % fällig am 16.01.2057	£	130	165	0,02
Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.				
6,780 % fällig am 25.09.2035	$	4	4	0,00
Countrywide Alternative Loan Trust				
4,976 % fällig am 25.12.2035		45	38	0,00
5,430 % fällig am 25.04.2047		308	274	0,02
5,470 % fällig am 25.09.2047		35	30	0,00
5,500 % fällig am 25.04.2035		1.004	708	0,06
5,570 % fällig am 25.07.2046		12	10	0,00
5,750 % fällig am 25.05.2036		72	31	0,00
5,797 % fällig am 20.12.2035		941	878	0,08
6,000 % fällig am 25.11.2036 ^		130	72	0,01
6,000 % fällig am 25.07.2037		430	222	0,02
Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust				
5,750 % fällig am 25.12.2035 ^		12	6	0,00
5,750 % fällig am 25.02.2037 ^		492	236	0,02
5,750 % fällig am 25.08.2037		612	335	0,03
6,000 % fällig am 25.07.2036		266	144	0,01
6,500 % fällig am 25.11.2036 ^		7	3	0,00
Domi BV				
4,376 % fällig am 15.06.2051	€	672	734	0,07
Downey Savings & Loan Association Mortgage Loan Trust				
5,347 % fällig am 19.10.2036	$	398	330	0,03
Dutch Property Finance BV				
3,892 % fällig am 28.07.2054	€	274	298	0,03
EMF-UK PLC				
5,970 % fällig am 13.03.2046	£	39	49	0,00
Eurohome UK Mortgages PLC				
5,137 % fällig am 15.06.2044		80	98	0,01
European Loan Conduit DAC				
4,358 % fällig am 17.02.2030	€	3.440	3.675	0,33
Eurosail PLC				
5,940 % fällig am 13.06.2045	£	245	307	0,03
Friary PLC				
5,467 % fällig am 21.11.2067		442	564	0,05
Great Hall Mortgages PLC				
5,166 % fällig am 18.06.2039		61	77	0,01
5,172 % fällig am 18.06.2038		26	33	0,00
GSMPS Mortgage Loan Trust				
5,500 % fällig am 25.03.2035	$	90	79	0,01
GSR Mortgage Loan Trust				
6,000 % fällig am 25.01.2037		1.202	756	0,07
HarborView Mortgage Loan Trust				
5,537 % fällig am 19.01.2038		36	34	0,00
5,567 % fällig am 19.12.2036		3.933	3.287	0,29
5,976 % fällig am 19.10.2035		455	256	0,02
Harmony French Home Loans				
4,107 % fällig am 27.05.2062	€	6.132	6.719	0,60
IndyMac Mortgage Loan Trust				
5,570 % fällig am 25.07.2036	$	1.821	1.682	0,15
JPMorgan Alternative Loan Trust				
5,510 % fällig am 25.06.2037		4.090	2.231	0,20
Jubilee Place BV				
4,177 % fällig am 17.10.2057	€	1.551	1.692	0,15
Landmark Mortgage Securities PLC				
4,865 % fällig am 17.04.2044	£	151	186	0,02
Lehman XS Trust				
5,550 % fällig am 25.08.2046	$	182	167	0,02
5,600 % fällig am 25.08.2046		362	351	0,03
Ludgate Funding PLC				
3,654 % fällig am 01.12.2060	€	19	20	0,00
5,068 % fällig am 01.12.2060	£	135	162	0,01
Mansard Mortgages PLC				
4,765 % fällig am 15.04.2047		37	45	0,00
5,651 % fällig am 15.12.2049		131	163	0,01
MASTR Adjustable Rate Mortgages Trust				
7,400 % fällig am 25.11.2034	$	779	756	0,07
Morgan Stanley Mortgage Loan Trust				
3,732 % fällig am 25.12.2037		1.034	719	0,06
6,354 % fällig am 25.08.2036 ^		10.607	2.122	0,19
Mortgage Equity Conversion Asset Trust				
5,790 % fällig am 25.05.2042		360	336	0,03
NAAC Reperforming Loan REMIC Trust Certificates				
6,500 % fällig am 25.02.2035 ^	$	491	$ 440	0,04
New Century Alternative Mortgage Loan Trust				
4,654 % fällig am 25.10.2036		503	104	0,01
Newgate Funding PLC				
4,126 % fällig am 15.12.2050	€	77	81	0,01
5,165 % fällig am 15.12.2050	£	217	261	0,02
NovaStar Mortgage Funding Trust				
0,440 % fällig am 25.09.2046	$	2.117	741	0,07
OBX Trust				
5,800 % fällig am 25.06.2057		141	134	0,01
Paragon Mortgages PLC				
5,752 % fällig am 15.05.2045	£	278	354	0,03
Residential Accredit Loans, Inc. Trust				
5,750 % fällig am 25.06.2036 ^	$	20	16	0,00
6,000 % fällig am 25.04.2036		965	777	0,07
6,000 % fällig am 25.06.2036 ^		138	110	0,01
Residential Asset Securitization Trust				
6,500 % fällig am 25.06.2037		2.901	714	0,06
RMAC Securities PLC				
5,134 % fällig am 12.06.2044	£	43	53	0,00
Shamrock Residential DAC				
4,289 % fällig am 24.12.2059	€	2.160	2.334	0,21
4,289 % fällig am 24.01.2061		3.309	3.572	0,32
Silverstone Master Issuer PLC				
5,249 % fällig am 21.01.2070	£	930	1.184	0,11
Stratton BTL Mortgage Funding PLC				
5,221 % fällig am 20.01.2054		9.251	11.701	1,04
Stratton Mortgage Funding PLC				
5,391 % fällig am 20.07.2060		3.547	4.510	0,40
5,792 % fällig am 25.09.2051		8.277	10.498	0,94
Structured Asset Mortgage Investments Trust				
5,370 % fällig am 25.09.2047	$	676	564	0,05
Towd Point Mortgage Funding PLC				
5,635 % fällig am 20.10.2051	£	3.547	4.517	0,40
5,841 % fällig am 20.07.2045		1.234	1.570	0,14
6,216 % fällig am 20.02.2045		233	296	0,03
6,547 % fällig am 20.02.2054		843	1.072	0,10
Trinidad Mortgage Securities PLC				
5,443 % fällig am 24.01.2059		23	29	0,00
Twin Bridges PLC				
5,715 % fällig am 12.03.2055		7.161	9.072	0,81
WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust				
3,753 % fällig am 25.02.2037 ^	$	71	65	0,01
Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates Trust				
5,750 % fällig am 25.07.2036 ^		99	57	0,01
Wells Fargo Mortgage-Backed Securities Trust				
5,615 % fällig am 25.07.2034		9	9	0,00
			95.589	8,52

FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE

BESCHREIBUNG		PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
Accredited Mortgage Loan Trust				
5,410 % fällig am 25.09.2036		487	479	0,04
6,095 % fällig am 25.09.2035		1.500	1.213	0,11
Accunia European CLO DAC				
4,127 % fällig am 15.07.2030	€	2.058	2.217	0,20
ACE Securities Corp. Home Equity Loan Trust				
5,430 % fällig am 25.07.2036	$	98	73	0,01
5,450 % fällig am 25.07.2036		1.038	386	0,03
5,765 % fällig am 25.12.2035		2.800	2.497	0,22
Ameriquest Mortgage Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates				
5,855 % fällig am 25.11.2035		1.106	1.077	0,10
6,020 % fällig am 25.01.2036		3.400	3.168	0,28
6,170 % fällig am 25.09.2034		1.112	1.079	0,10
Apidos CLO				
6,260 % fällig am 20.04.2031		1.000	990	0,09
Ares European CLO DAC				
4,050 % fällig am 20.04.2032	€	2.500	2.676	0,24
Argent Securities Trust				
5,370 % fällig am 25.05.2036	$	165	41	0,00
5,450 % fällig am 25.07.2036		105	89	0,01
Argent Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates				
5,630 % fällig am 25.05.2035		75	67	0,01
Atlas Senior Loan Fund Ltd.				
6,350 % fällig am 15.01.2031	$	2.858	$ 2.822	0,25
Aurium CLO DAC				
3,907 % fällig am 16.01.2031	€	4.693	5.022	0,45
4,618 % fällig am 23.03.2032		5.000	5.373	0,48
Bain Capital Euro CLO DAC				
4,311 % fällig am 24.01.2033		2.000	2.140	0,19
Bayview Financial Acquisition Trust				
6,596 % fällig am 28.12.2036	$	215	229	0,02
BBVA Consumer Auto				
0,270 % fällig am 20.07.2031	€	499	531	0,05
Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust				
5,368 % fällig am 25.02.2036	$	1.182	1.178	0,11
5,380 % fällig am 25.02.2037		3.000	2.729	0,24
6,005 % fällig am 25.07.2034		1.359	1.309	0,12
6,170 % fällig am 25.10.2035		317	309	0,03
6,200 % fällig am 25.08.2037		814	683	0,06
Black Diamond CLO DAC				
4,303 % fällig am 15.05.2032	€	4.600	4.910	0,44
Blackrock European CLO DAC				
3,797 % fällig am 15.10.2031		5.400	5.756	0,51
Cairn CLO DAC				
3,912 % fällig am 31.01.2030		597	641	0,06
4,051 % fällig am 25.07.2029		43	47	0,00
4,212 % fällig am 20.10.2028		12	13	0,00
Carlyle Euro CLO DAC				
3,953 % fällig am 15.08.2030		2.626	2.801	0,25
Carlyle Global Market Strategies CLO Ltd.				
6,360 % fällig am 15.10.2030	$	1.634	1.627	0,15
Carlyle Global Market Strategies Euro CLO Ltd.				
4,073 % fällig am 15.11.2031	€	800	856	0,08
CBAM Ltd.				
6,500 % fällig am 20.07.2030	$	2.144	2.136	0,19
Cedar Funding CLO Ltd.				
6,230 % fällig am 20.04.2031		1.100	1.088	0,10
6,250 % fällig am 20.01.2031		5.012	4.977	0,44
CIFC Funding Ltd.				
6,050 % fällig am 20.01.2028		478	477	0,04
6,262 % fällig am 18.04.2031		700	694	0,06
CIT Mortgage Loan Trust				
6,650 % fällig am 25.10.2037		5.500	5.354	0,48
Citigroup Mortgage Loan Trust				
5,210 % fällig am 25.07.2045		385	267	0,02
5,320 % fällig am 25.07.2045		7.181	5.010	0,45
5,450 % fällig am 25.12.2036		99	40	0,00
7,250 % fällig am 25.05.2036		847	451	0,04
Citigroup Mortgage Loan Trust Asset-Backed Pass-Through Certificates				
6,095 % fällig am 25.10.2034		48	46	0,00
Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.				
5,410 % fällig am 25.03.2037		2.936	2.486	0,22
Contego CLO BV				
3,947 % fällig am 15.10.2030	€	1.598	1.716	0,15
Contego CLO DAC				
3,851 % fällig am 23.01.2030		3.989	4.266	0,38
Countrywide Asset-Backed Certificates Trust				
4,225 % fällig am 25.05.2036	$	2.594	2.549	0,23
5,290 % fällig am 25.06.2035		3.357	2.925	0,26
5,330 % fällig am 25.11.2047 ^		784	865	0,08
5,350 % fällig am 25.06.2047 ^		2.839	2.456	0,22
5,360 % fällig am 25.05.2047 ^		74	64	0,01
5,370 % fällig am 25.09.2037 ^		365	366	0,03
5,810 % fällig am 25.08.2035		318	308	0,03
Credit-Based Asset Servicing & Securitization LLC				
3,044 % fällig am 25.12.2036 ^		160	127	0,01
6,065 % fällig am 25.01.2034		471	452	0,04
CVC Cordatus Loan Fund DAC				
3,855 % fällig am 21.07.2030	€	3.983	4.274	0,38
3,937 % fällig am 15.04.2032		3.416	3.664	0,33
4,103 % fällig am 15.08.2032		5.471	5.856	0,52
Dryden Euro CLO DAC				
3,837 % fällig am 15.04.2033		4.500	4.803	0,43
4,027 % fällig am 15.07.2031		487	524	0,05
Elevation CLO Ltd.				
6,478 % fällig am 15.10.2029	$	1.174	1.174	0,10
Ellington Loan Acquisition Trust				
6,250 % fällig am 25.05.2037		3.172	3.038	0,27

BESCHREIBUNG		PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
Euro-Galaxy CLO DAC				
3,765 % fällig am 11.04.2031	€	1.183	$ 1.267	0,11
Fieldstone Mortgage Investment Trust				
5,818 % fällig am 25.04.2047	$	1.993	1.407	0,13
Fremont Home Loan Trust				
5,285 % fällig am 25.10.2036		148	131	0,01
5,350 % fällig am 25.08.2036		211	71	0,01
6,020 % fällig am 25.05.2034		1.325	1.225	0,11
GE-WMC Mortgage Securities Trust				
5,450 % fällig am 25.08.2036		5.159	2.258	0,20
Greenwood Park CLO Ltd.				
6,290 % fällig am 15.04.2031		1.250	1.240	0,11
Greystone Commercial Real Estate Notes Ltd.				
6,373 % fällig am 15.09.2037		2.253	2.223	0,20
GSAA Home Equity Trust				
5,772 % fällig am 25.11.2036 ^		468	144	0,01
5,985 % fällig am 25.06.2036		1.350	373	0,03
GSAMP Trust				
5,290 % fällig am 25.11.2036		1.900	905	0,08
5,670 % fällig am 25.02.2046		531	488	0,04
HSI Asset Securitization Corp. Trust				
5,930 % fällig am 25.01.2036		2.200	1.722	0,15
ICG U.S. CLO Ltd.				
6,353 % fällig am 22.07.2031		5.200	5.141	0,46
Jubilee CLO DAC				
4,326 % fällig am 15.12.2029	€	1.160	1.251	0,11
LCM LP				
6,290 % fällig am 20.10.2027	$	126	126	0,01
Lehman XS Trust				
6,119 % fällig am 25.03.2037		1.901	1.877	0,17
LoanCore Issuer Ltd.				
6,616 % fällig am 17.01.2037		500	492	0,04
Long Beach Mortgage Loan Trust				
5,590 % fällig am 25.02.2036		340	329	0,03
6,065 % fällig am 25.08.2035		4.270	3.769	0,34
Madison Park Funding Ltd.				
6,103 % fällig am 22.04.2027		546	543	0,05
Man GLG Euro CLO DAC				
3,857 % fällig am 15.10.2030	€	2.198	2.355	0,21
4,023 % fällig am 15.05.2031		499	535	0,05
4,047 % fällig am 15.01.2030		440	474	0,04
Midocean Credit CLO				
6,385 % fällig am 19.07.2028	$	104	104	0,01
Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust				
5,220 % fällig am 25.10.2036		1.420	617	0,06
5,280 % fällig am 25.11.2036		1.660	754	0,07
5,290 % fällig am 25.05.2037		1.361	1.184	0,11
5,380 % fällig am 25.10.2036		1.152	610	0,05
5,380 % fällig am 25.11.2036		5.128	2.828	0,25
5,400 % fällig am 25.07.2036		426	367	0,03
5,450 % fällig am 25.09.2036		15.068	5.672	0,51
5,650 % fällig am 25.04.2036		99	92	0,01
5,690 % fällig am 25.12.2034		1.362	1.194	0,11
Morgan Stanley Home Equity Loan Trust				
5,660 % fällig am 25.02.2036		1.800	1.624	0,14
Morgan Stanley Mortgage Loan Trust				
6,226 % fällig am 25.10.2036 ^		272	84	0,01
Nomura Home Equity Loan, Inc. Home Equity Loan Trust				
5,950 % fällig am 25.02.2037 ^		3.172	945	0,08
NovaStar Mortgage Funding Trust				
5,310 % fällig am 25.09.2037		17	16	0,00
5,470 % fällig am 25.05.2036		44	43	0,00
Oak Hill European Credit Partners DAC				
3,930 % fällig am 20.01.2032	€	669	718	0,06
Option One Mortgage Loan Trust				
5,290 % fällig am 25.01.2037	$	51	29	0,00
5,290 % fällig am 25.02.2037		614	404	0,04
5,290 % fällig am 25.03.2037		728	653	0,06

BESCHREIBUNG		PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
5,370 % fällig am 25.04.2037	$	583	$ 416	0,04
5,370 % fällig am 25.05.2037		643	380	0,03
OZLM Ltd.				
6,280 % fällig am 15.04.2031		2.400	2.364	0,21
6,340 % fällig am 17.04.2031		985	972	0,09
6,400 % fällig am 20.01.2031		1.717	1.700	0,15
OZLME DAC				
4,088 % fällig am 27.07.2032	€	2.198	2.339	0,21
Palmer Square European Loan Funding DAC				
5,025 % fällig am 12.04.2032		4.774	5.237	0,47
Popular ABS Mortgage Pass-Through Trust				
5,645 % fällig am 25.07.2036	$	638	597	0,05
RAAC Trust				
5,910 % fällig am 25.10.2046		94	89	0,01
Residential Asset Securities Corp. Trust				
5,490 % fällig am 25.11.2036		44	41	0,00
5,735 % fällig am 25.03.2036		965	951	0,08
Sculptor European CLO DAC				
3,916 % fällig am 14.01.2032	€	5.000	5.359	0,48
Securitized Asset-Backed Receivables LLC Trust				
5,470 % fällig am 25.10.2036	$	9.702	3.377	0,30
5,810 % fällig am 25.08.2035 ^		55	43	0,00
Segovia European CLO DAC				
4,080 % fällig am 20.07.2032	€	6.900	7.335	0,65
SG Mortgage Securities Trust				
5,360 % fällig am 25.10.2036	$	3.600	2.493	0,22
Sierra Madre Funding Ltd.				
5,571 % fällig am 07.09.2039		2.087	1.495	0,13
Sound Point CLO Ltd.				
6,368 % fällig am 26.07.2031		1.000	983	0,09
6,412 % fällig am 18.04.2031		7.400	7.271	0,65
Soundview Home Loan Trust				
5,350 % fällig am 25.06.2037		2.237	1.529	0,14
5,410 % fällig am 25.02.2037		1.004	291	0,03
5,650 % fällig am 25.10.2036		1.395	1.302	0,12
Structured Asset Investment Loan Trust				
6,125 % fällig am 25.01.2035		1.685	1.507	0,13
Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust				
5,305 % fällig am 25.09.2036		4.731	2.975	0,27
6,670 % fällig am 25.04.2035		27	27	0,00
Toro European CLO DAC				
4,097 % fällig am 15.07.2030	€	223	241	0,02
WaMu Asset-Backed Certificates WaMu Trust				
5,375 % fällig am 25.05.2037	$	485	445	0,04
Wells Fargo Home Equity Asset-Backed Securities Trust				
5,750 % fällig am 25.04.2037		4.701	3.241	0,29
6,875 % fällig am 25.11.2035		100	98	0,01
			220.863	19,70
STAATSEMISSIONEN				
Argentina Government International Bond				
0,500 % fällig am 09.07.2030		1.422	470	0,04
1,000 % fällig am 09.07.2029		150	49	0,00
1,500 % fällig am 09.07.2035		2.504	754	0,07
Japan Finance Organization for Municipalities				
0,050 % fällig am 12.02.2027	€	1.500	1.437	0,13
Mexico Government International Bond				
5,400 % fällig am 09.02.2028	$	1.700	1.733	0,15
Peru Government International Bond				
5,940 % fällig am 12.02.2029	PEN	2.300	624	0,05
Romania Government International Bond				
1,750 % fällig am 13.07.2030	€	1.500	1.251	0,11
Russia Government International Bond				
4,250 % fällig am 23.06.2027 ^	$	200	87	0,01
4,750 % fällig am 27.05.2026 ^		200	101	0,01
5,100 % fällig am 28.03.2035 ^		400	178	0,02
5,250 % fällig am 23.06.2047 ^		200	89	0,01

BESCHREIBUNG		PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
5,250 % fällig am 23.06.2047 ^		400	24	0,00
South Africa Government International Bond				
4,850 % fällig am 30.09.2029	$	2.000	$ 1.763	0,16
Turkey Government International Bond				
5,750 % fällig am 22.03.2024		1.000	985	0,09
6,350 % fällig am 10.08.2024		2.500	2.462	0,22
			12.007	1,07
		AKTIEN		
STAMMAKTIEN				
ENERGIE				
Constellation Oil Services Holding S.A. 'B' (b)(i)		617.385	67	0,01
VORZUGSWERTPAPIERE				
Nationwide Building Society				
10,250 %		521	76	0,01
		PAR (000S)		
KURZFRISTIGE INSTRUMENTE				
KURZFRISTIGE SCHULDTITEL				
Warnermedia Holdings, Inc.				
3,528 % fällig am 15.03.2024	$	4.000	3.929	0,35
ARGENTINA TREASURY BILLS				
(54,758) % fällig am 18.09.2023 (c)(d)	ARS	12.597	25	0,00
(28,578) % fällig am 18.10.2023 (c)(d)		57.270	113	0,01
(12,549) % fällig am 23.11.2023 (c)(d)		55.871	113	0,01
			251	0,02
HUNGARY TREASURY BILLS				
16,220 % fällig am 06.07.2023 (c)(d)	HUF	4.402.000	12.849	1,15
Summe kurzfristige Instrumente			17.029	1,52
Summe Übertragbare Wertpapiere			**$ 1.055.335**	**94,11**
		AKTIEN		
INVESTMENTFONDS				
ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN				
PIMCO Funds: Global Investors Series plc - Asia Strategic Interest Bond Fund (g)		1.197.507	10.706	0,96
PIMCO Funds: Global Investors Series plc - PIMCO Asia High Yield Bond Fund (g)		385.356	3.503	0,31
PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (g)		3.341.950	33.279	2,97
			47.488	4,24
BÖRSENGEHANDELTE FONDS				
PIMCO ETFs plc - PIMCO US Dollar Short Maturity UCITS ETF (g)		614.500	61.038	5,44
Summe Investmentfonds			**$ 108.526**	**9,68**

PENSIONSGESCHÄFTE

Kontrahent	Kredit-zins	Abrechnungs-datum	Fälligkeits-datum	Kapital-betrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensions-geschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensions-geschäft[1]	% des Nettovermögens
BPS	5,120 %	30.06.2023	03.07.2023	$ 87.900	U.S. Treasury Notes 3,500 % fällig am 31.01.2028	$ (89.679)	$ 87.900	$ 87.938	7,84
	5,160	30.06.2023	03.07.2023	4.300	U.S. Treasury Notes 2,000 % fällig am 15.08.2025	(4.392)	4.300	4.302	0,38

Kontrahent	Kredit-zins	Abrechnungs-datum	Fälligkeits-datum	Kapital-betrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensions-geschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensions-geschäft[1]	% des Nettovermögens
	5,180 %	30.06.2023	03.07.2023	$ 100	U.S. Treasury Notes 0,375 % fällig am 30.04.2025	$ (102)	$ 100	$ 100	0,01
FICC	2,400	30.06.2023	03.07.2023	2.587	U.S. Treasury Notes 4,625 % fällig am 30.06.2025	(2.639)	2.587	2.587	0,23
Summe Pensionsgeschäfte						**$ (96.812)**	**$ 94.887**	**$ 94.927**	**8,46**

(1) Umfasst aufgelaufene Zinsen.

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

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

FUTURES

Beschreibung	Art	Ablauf-monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Euro-Bobl September Futures	Short	09.2023	297	$ 541	0,05
Euro-Bund 10-Year Bond September Futures	Short	09.2023	165	234	0,02
Euro-Buxl 30-Year Bond September Futures	Long	09.2023	12	27	0,00
Euro-Schatz September Futures	Short	09.2023	435	426	0,04
U.S. Treasury 2-Year Note September Futures	Long	09.2023	445	(1.217)	(0,11)
U.S. Treasury 5-Year Note September Futures	Short	09.2023	531	1.084	0,10
U.S. Treasury 10-Year Note September Futures	Short	09.2023	1.433	2.576	0,23
U.S. Treasury 10-Year Ultra September Futures	Short	09.2023	522	393	0,03
				$ 4.064	0,36

VERKAUFSOPTIONEN

OPTIONEN AUF BÖRSENGEHANDELTE TERMINKONTRAKTE

Beschreibung	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Anzahl der Kontrakte	Aufgeld	Markt-wert	% des Nettovermögens
Call - CME-Kaufoptionen mit Ausübungskurs bei 98,000 USD auf 3-Month SOFR December Futures	$ 98,000	15.12.2023	133	$ 0	$ (7)	0,00
Put - CME-Verkaufsoptionen mit Ausübungskurs bei 96,500 USD auf 3-Month SOFR December Futures	96,500	15.12.2023	133	0	(626)	(0,05)
				$ 0	$ (633)	(0,05)
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate					**$ 3.431**	**0,31**

ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)

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

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMMISSIONEN - SCHUTZVERKAUF[1]

Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag[3]	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
AT&T, Inc.	1,000 %	20.06.2024	$ 3.200	$ 16	0,00
AT&T, Inc.	1,000	20.06.2026	1.700	(19)	0,00
AT&T, Inc.	1,000	20.06.2028	200	1	0,00
Ford Motor Credit Co. LLC	5,000	20.06.2027	500	23	0,00
General Electric Co.	1,000	20.06.2026	1.700	8	0,00
				$ 29	0,00

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZKAUF[2]

Index/Tranchen	Zu bezahlender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag[3]	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
CDX.HY-34 5-Year Index	(5,000) %	20.06.2025	$ 20.700	$ (1.972)	(0,17)
CDX.HY-39 5-Year Index	(5,000)	20.12.2027	10.989	(517)	(0,05)
CDX.HY-40 5-Year Index	(5,000)	20.06.2028	15.000	(350)	(0,03)
				$ (2.839)	(0,25)

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES - SCHUTZVERKAUF[1]

Index/Tranchen	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag[3]	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
CDX.IG-40 5-Year Index	1,000 %	20.06.2028	$ 1.600	$ 12	0,00

ZINSSWAPS

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Zahlung[4]	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	3,500 %	20.09.2033	£ 29.800	$ (1.475)	(0,13)
Erhalt[4]	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	3,750	20.09.2028	27.500	1.778	0,16

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits-datum		Nenn-betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	0,000 %	04.08.2023	$	335.700	$ 4.631	0,41
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	0,000	17.09.2023		5.000	(68)	(0,01)
Zahlung[4]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	0,500	16.06.2026		16.480	(1.277)	(0,11)
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,250	17.06.2030		5.000	697	0,06
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,270	04.11.2023		335.700	(6.658)	(0,59)
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,750	21.12.2052		34.600	2.571	0,23
Zahlung[4]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,827	03.07.2028		73.000	(6.790)	(0,61)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,853	18.05.2032		37.780	(4.768)	(0,43)
Erhalt[4]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,999	03.07.2053		14.900	3.317	0,30
Erhalt[4]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,000	12.02.2030		9.900	1.280	0,11
Erhalt[4]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,000	10.03.2030		4.900	541	0,05
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,000	21.06.2033		13.000	33	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,080	23.02.2053		1.000	(18)	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,370	01.03.2033		1.400	(24)	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,400	23.02.2033		2.800	(41)	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,405	01.03.2033		1.400	(20)	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,425	01.03.2033		1.400	(18)	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,430	27.02.2033		1.900	(24)	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,450	07.03.2033		1.500	(16)	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,470	22.02.2030		4.900	(82)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,800	10.03.2028		2.600	(21)	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,055	04.01.2027	BRL	18.600	23	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,086	04.01.2027		114.100	139	0,01
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,098	04.01.2027		76.900	99	0,01
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,734	02.01.2025		24.800	(3)	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,800	02.01.2025		111.000	14	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,814	04.01.2027		69.000	404	0,04
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,835	02.01.2025		111.000	29	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,868	04.01.2027		14.300	88	0,01
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	2,000	14.11.2023	CAD	44.700	(549)	(0,05)
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	2,060	28.10.2023		139.400	(1.735)	(0,16)
Zahlung	3-Month CAD-CAONREPO Compounded-OIS	4,000	21.06.2025		111.800	(813)	(0,07)
Zahlung	3-Month NZD-BBR	3,000	01.11.2023	NZD	120.200	(1.031)	(0,09)
Zahlung	3-Month NZD-BBR	3,000	15.12.2023		139.900	(1.155)	(0,10)
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	0,000	04.08.2023	$	335.700	(4.605)	(0,41)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	0,000	17.09.2023		5.000	69	0,01
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	0,500	16.09.2023		16.480	(216)	(0,02)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,000	12.08.2023		9.900	39	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,000	10.09.2023		4.900	20	0,00
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,250	28.04.2024	€	11.000	(164)	(0,01)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,250	03.05.2024		11.300	(169)	(0,02)
Erhalt[4]	6-Month EUR-EURIBOR	3,000	20.09.2028		18.300	(60)	(0,01)
Zahlung[4]	6-Month EUR-EURIBOR	3,000	20.09.2033		6.000	53	0,00
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR	6,985	11.10.2027	PLN	69.300	(1.821)	(0,16)
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR	7,015	11.10.2027		64.100	(1.705)	(0,15)
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR	7,156	13.10.2027		42.800	(1.206)	(0,11)
						$ (20.707)	(1,85)
Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate						**$ (23.505)**	**(2,10)**

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

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

(3) Der maximal mögliche Betrag, den der Fonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

(4) Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft.

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

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

OPTIONSKAUF

ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag[1]	Kosten	Markt-wert	% des Nettovermögens
BOA	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	0,021 %	25.10.2023	6.200	$ 354	$ 1.572	0,14
FAR	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	0,021	15.09.2023	10.500	551	2.529	0,23
MYC	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	0,021	15.09.2023	11.000	598	2.739	0,24
							$ 1.503	$ 6.840	0,61

VERKAUFSOPTIONEN

ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag[1]	Aufgeld	Markt-wert	% des Nettovermögens
BOA	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	0,020 %	25.10.2023	31.000	$ (355)	$ (2.790)	(0,25)
FAR	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	0,020	15.09.2023	52.500	(551)	(4.876)	(0,43)
GLM	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,018	20.10.2023	4.600	(30)	(1)	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,018	20.10.2023	4.600	(30)	(93)	(0,01)
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,140	23.10.2023	4.600	(32)	(1)	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,140	23.10.2023	4.600	(32)	(88)	(0,01)
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,190	23.10.2023	4.600	(32)	(1)	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,190	23.10.2023	4.600	(32)	(86)	(0,01)
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,225	23.10.2023	4.600	(32)	(1)	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,225	23.10.2023	4.600	(32)	(85)	(0,01)
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,973	25.10.2023	4.600	(32)	(1)	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,973	25.10.2023	4.600	(32)	(95)	(0,01)
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,841	27.10.2023	4.700	(32)	(1)	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,841	27.10.2023	4.700	(32)	(102)	(0,01)
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,250	17.11.2023	24.600	(89)	(2)	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,750	17.11.2023	24.600	(89)	(320)	(0,03)
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,150	20.11.2023	36.100	(126)	(3)	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,650	20.11.2023	36.100	(126)	(500)	(0,04)
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,250	07.12.2023	13.300	(41)	(2)	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,750	07.12.2023	13.300	(42)	(166)	(0,01)
MYC	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	0,020	15.09.2023	55.000	(598)	(5.183)	(0,46)
							$ (2.397)	$ (14.397)	(1,28)

(1) Der Nennbetrag stellt die Anzahl der Kontrakte dar.

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMMISSIONEN – SCHUTZKAUF[1]

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu bezahlender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag[3]	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Markt-wert	% des Nettovermögens
BOA	UBS AG	(1,000) %	20.06.2024	$ 200	$ 13	$ (13)	$ 0	0,00

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMMISSIONEN - SCHUTZVERKAUF[2]

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag[3]	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Markt-wert	% des Nettovermögens
BRC	Turkey Government International Bond	1,000 %	20.06.2024	$ 200	$ (26)	$ 22	$ (4)	0,00
GLM	Petrobras Global Finance BV	1,000	20.12.2023	1.200	(88)	92	4	0,00
GST	Brazil Government International Bond	1,000	20.12.2024	200	(3)	5	2	0,00
	South Africa Government International Bond	1,000	20.06.2024	2.300	(102)	102	0	0,00
					$ (219)	$ 221	$ 2	0,00

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES - SCHUTZVERKAUF[2]

Kontrahent	Index/Tranchen	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag[3]	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Markt-wert	% des Nettovermögens
GST	CMBX.NA.AAA.10 Index	0,500 %	17.11.2059	$ 2.200	$ (9)	$ 0	$ (9)	0,00
MYC	CMBX.NA.AAA.10 Index	0,500	17.11.2059	100	(4)	3	(1)	0,00
SAL	CMBX.NA.AAA.10 Index	0,500	17.11.2059	1.500	(3)	(3)	(6)	0,00
UAG	CMBX.NA.AAA.10 Index	0,500	17.11.2059	300	(9)	8	(1)	0,00
					$ (25)	$ 8	$ (17)	0,00

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

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

(3) Der maximal mögliche Betrag, den der Fonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung		Zu erhaltende Währung		Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
AZD	07.2023	AUD	1.039	$	689	$ 0	$ (2)	$ (2)	0,00
	07.2023	$	459	AUD	702	8	0	8	0,00
	08.2023		690		1.039	2	0	2	0,00
BOA	07.2023	¥	800	$	6	0	0	0	0,00
	07.2023	MXN	62.112		3.374	0	(239)	(239)	(0,02)
	07.2023	PLN	9.887		2.400	0	(32)	(32)	0,00
	07.2023	$	1.564	AUD	2.401	34	0	34	0,00
	07.2023		1.129	£	893	6	0	6	0,00
	07.2023		519	PLN	2.173	16	0	16	0,00
	08.2023	CNY	287	$	42	2	0	2	0,00
	08.2023	NZD	356		226	8	0	8	0,00
	08.2023	$	749	BRL	3.647	4	0	4	0,00
	08.2023	ZAR	97	$	5	0	0	0	0,00
	09.2023	TWD	886		29	1	0	1	0,00
BPS	07.2023	AUD	743		492	0	(2)	(2)	0,00
	07.2023	€	220.055		236.596	2	(3.485)	(3.483)	(0,31)
	07.2023	PEN	6.822		1.865	0	(17)	(17)	0,00
	07.2023	PLN	22.175		5.165	0	(288)	(288)	(0,02)
	07.2023	$	238.529	€	217.701	2	(1.019)	(1.017)	(0,09)
	07.2023		1.339	£	1.054	1	0	1	0,00
	07.2023		14.447	¥	2.008.078	0	(553)	(553)	(0,05)
	07.2023		3.742	PEN	13.643	21	0	21	0,00
	08.2023	CNH	2.053	$	297	14	0	14	0,00
	08.2023	CNY	151		22	1	0	1	0,00
	08.2023	€	216.580		237.640	1.028	0	1.028	0,09
	08.2023	TWD	443		15	0	0	0	0,00
	08.2023	$	492	AUD	743	2	0	2	0,00
	08.2023		44	CNH	307	0	(2)	(2)	0,00
	08.2023		889	ZAR	16.553	0	(17)	(17)	0,00
	09.2023		42	PEN	153	0	0	0	0,00
	09.2023		0	THB	5	0	0	0	0,00
BRC	07.2023	MYR	27	$	6	0	0	0	0,00
	07.2023	PLN	1.430		342	0	(9)	(9)	0,00
	07.2023	$	1.079	£	867	23	0	23	0,00
	08.2023		2.409	COP	10.264.091	19	0	19	0,00
	08.2023		1.061	HUF	364.628	0	(7)	(7)	0,00
	08.2023		1.084	ZAR	20.028	0	(28)	(28)	0,00
	10.2023	MXN	112.225	$	5.990	0	(428)	(428)	(0,04)
CBK	07.2023	CAD	1.784		1.309	0	(39)	(39)	0,00
	07.2023	CLP	5.783.983		7.147	0	(56)	(56)	(0,01)
	07.2023	PEN	6.822		1.878	0	(3)	(3)	0,00
	07.2023	$	1.086	€	1.004	9	0	9	0,00
	07.2023		2.286	PEN	8.474	51	0	51	0,01
	07.2023		4	PHP	225	0	0	0	0,00
	08.2023	CNY	14	$	2	0	0	0	0,00
	08.2023	TWD	427		14	0	0	0	0,00
	08.2023	$	7.154	CLP	5.853.517	91	0	91	0,01
	08.2023		1.343	PEN	5.246	99	0	99	0,01
	09.2023	IDR	88.939	$	6	0	0	0	0,00
GLM	07.2023	BRL	53.329		11.045	0	(10)	(10)	0,00
	07.2023	$	9.869	BRL	53.160	1.149	0	1.149	0,10
	07.2023		1.775	PLN	7.517	73	0	73	0,01
	08.2023	BRL	10.431	$	2.040	0	(112)	(112)	(0,01)
	09.2023	PEN	25.621		6.954	0	(72)	(72)	(0,01)
	09.2023	$	11.045	BRL	53.920	9	0	9	0,00
	10.2023		2.530	MXN	44.410	10	0	10	0,00
MBC	07.2023	CAD	987	$	740	0	(6)	(6)	0,00
	07.2023	€	741		793	0	(16)	(16)	0,00
	07.2023	£	66.391		82.183	0	(2.223)	(2.223)	(0,20)
	07.2023	PLN	57.869		13.366	0	(866)	(866)	(0,08)
	07.2023	$	550	€	514	10	0	10	0,00
	08.2023	HUF	310.241	$	909	13	0	13	0,00
	08.2023	$	638	CNH	4.382	0	(34)	(34)	0,00
MYI	07.2023	PLN	1.262	$	310	0	(1)	(1)	0,00
	07.2023	$	204	€	187	0	0	0	0,00
	07.2023		1.258	£	997	9	0	9	0,00
	07.2023		1.233	¥	178.000	0	(2)	(2)	0,00
	07.2023		1.065	PLN	4.465	33	0	33	0,00
	08.2023	TWD	477	$	16	0	0	0	0,00
	08.2023	$	6	TWD	183	0	0	0	0,00
	09.2023	THB	13.411	$	392	11	0	11	0,00
RBC	07.2023	$	3	MXN	55	0	0	0	0,00
	08.2023		7.469		129.443	17	0	17	0,00
SCX	07.2023	AUD	1.526	$	1.013	0	(3)	(3)	0,00

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung		Zu erhaltende Währung		Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
	07.2023	$	1.346	AUD	2.060	$ 25	$ 0	$ 25	0,00
	08.2023	CNH	2.418	$	351	18	0	18	0,00
	08.2023	NZD	126		79	2	0	2	0,00
	08.2023	$	1.014	AUD	1.526	3	0	3	0,00
	09.2023	THB	9.533	$	276	5	0	5	0,00
	09.2023	TWD	740		24	1	0	1	0,00
	09.2023	$	147	PEN	541	2	0	2	0,00
SSB	07.2023	PEN	7.397	$	2.028	0	(12)	(12)	0,00
	07.2023	$	7.211	CLP	5.792.275	2	0	2	0,00
	08.2023	CLP	5.809.004	$	7.211	1	0	1	0,00
	08.2023	$	2.025	PEN	7.397	10	0	10	0,00
	09.2023	BRL	3.661	$	722	0	(28)	(28)	0,00
TOR	07.2023	AUD	1.878		1.240	0	(10)	(10)	0,00
	07.2023	$	1.605	AUD	2.454	29	0	29	0,00
	07.2023		2.094	CAD	2.771	2	(2)	0	0,00
	07.2023		82.127	£	64.631	42	0	42	0,01
	08.2023	CAD	2.770	$	2.094	1	(1)	0	0,00
	08.2023	£	64.631		82.145	0	(41)	(41)	0,00
	08.2023	$	1.241	AUD	1.878	10	0	10	0,00
UAG	07.2023	AUD	2.993	$	1.999	10	(4)	6	0,00
	07.2023	$	368	AUD	562	6	0	6	0,00
	08.2023		2.000		2.993	4	(10)	(6)	0,00
	08.2023	ZAR	33.701	$	1.755	1	(22)	(21)	0,00
						$ 2.952	$ (9.701)	$ (6.749)	(0,60)

ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 30. Juni 2023 standen für die Institutional EUR (Hedged) thesaurierend, Institutional EUR (Hedged) ausschüttend, Investor EUR (Hedged) thesaurierend und Class E EUR (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung		Zu erhaltende Währung		Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2023	$	12.204	€	11.353	$ 182	$ 0	$ 182	0,02
BPS	07.2023	€	11.365	$	12.453	54	0	54	0,00
	07.2023	$	12.085	€	11.241	179	0	179	0,02
	08.2023		12.449		11.346	0	(54)	(54)	(0,01)
CBK	07.2023	€	9.565	$	10.398	0	(38)	(38)	0,00
	07.2023	$	269	€	248	1	0	1	0,00
	08.2023		10.291		9.452	36	0	36	0,00
MBC	07.2023	€	91	$	98	0	(2)	(2)	0,00
	07.2023	$	119	€	110	2	0	2	0,00
MYI	07.2023	€	5.661	$	6.182	5	0	5	0,00
SCX	07.2023	$	12.026	€	11.238	234	0	234	0,02
						$ 693	$ (94)	$ 599	0,05

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklassen Institutional GBP (Hedged) thesaurierend und Institutional GBP (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung		Zu erhaltende Währung		Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2023	£	212	$	269	$ 0	$ (1)	$ (1)	0,00
BPS	07.2023		1.480		1.894	14	(2)	12	0,00
	07.2023	$	270.851	£	218.978	7.547	0	7.547	0,67
BRC	07.2023	£	507	$	635	0	(9)	(9)	0,00
CBK	07.2023		968		1.227	1	(4)	(3)	0,00
	07.2023	$	5	£	4	0	0	0	0,00
MBC	07.2023	£	73	$	94	1	0	1	0,00
	07.2023	$	270.330	£	218.380	7.307	0	7.307	0,65
MYI	07.2023		270.897		217.962	6.209	0	6.209	0,56
TOR	07.2023	£	218.130	$	277.177	0	(142)	(142)	(0,01)
	08.2023	$	277.238	£	218.130	137	0	137	0,01
UAG	07.2023		95.805		75.739	486	0	486	0,04
						$ 21.702	$ (158)	$ 21.544	1,92
Summe Freiverkehrsfinanzderivate								**$ 7.822**	**0,70**

LEERVERKAUFTE WERTPAPIERE

BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
US-REGIERUNGSBEHÖRDEN			
Uniform Mortgage-Backed Security, TBA			
2,000 % fällig am 01.08.2053	$ 55.800	$ (45.584)	(4,07)
Summe Leerverkaufte Wertpapiere		**$ (45.584)**	**(4,07)**
Summe Anlagen		**$ 1.200.912**	**107,09**
Sonstige Aktiva und Passiva		**$ (79.535)**	**(7,09)**
Nettovermögen		**$ 1.121.377**	**100,00**

ERLÄUTERUNGEN ZUR AUFSTELLUNG DES WERTPAPIERBESTANDS (Angaben in Tausend*):

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

^ **Das Wertpapier ist in Verzug.**

(a) **Wertpapier mit Sachwertausschüttung.**

(b) **Das Wertpapier hat in den letzten zwölf Monaten keine Erträge geliefert.**

(c) **Nullkuponwertpapier.**

(d) **Der Kupon stellt eine Rendite bis zur Endfälligkeit dar.**

(e) **Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.**

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

(g) **Mit dem Fonds verbunden.**

(h) **Bedingt wandelbares Wertpapier.**

(i) **Eingeschränkte Wertpapiere (31. Dezember 2022: 0,12 %):**

Emittentenbeschreibung	Kauf-datum	Kosten	Markt-wert	% des Nettovermögens
Constellation Oil Services Holding S.A. 'B'	10.06.2022	$ 67	$ 67	0,01
Deutsche Bank AG 3,729 %, fällig am 14.01.2032	11.01.2021 - 24.02.2021	2.202	1.665	0,15
		$ 2.269	$ 1.732	0,16

Barmittel in Höhe von 29.215 USD (31. Dezember 2022: 29.843 USD) wurden zum 30. Juni 2023 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Barmittel in Höhe von 6.884 USD (31. Dezember 2022: 27.963 USD) wurden zum 30. Juni 2023 gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. als Sicherheit für Finanzderivate verpfändet.

Beizulegender Zeitwert[1]

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 30. Juni 2023 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie[2]	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	$ 0	$ 1.054.967	$ 368	$ 1.055.335
Investmentfonds	108.526	0	0	108.526
Pensionsgeschäfte	0	94.887	0	94.887
Finanzderivate[3]	1.228	(13.480)	0	(12.252)
Leerverkaufte Wertpapiere	0	(45.584)	0	(45.584)
Summen	**$ 109.754**	**$ 1.090.790**	**$ 368**	**$ 1.200.912**

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

Kategorie[2]	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	$ 0	$ 1.216.185	$ 561	$ 1.216.746
Investmentfonds	72.181	60.875	0	133.056
Pensionsgeschäfte	0	118.800	0	118.800
Finanzderivate[3]	79	(54.248)	0	(54.169)
Leerverkaufte Wertpapiere	0	(94.108)	0	(94.108)
Summen	**$ 72.260**	**$ 1.247.504**	**$ 561**	**$ 1.320.325**

(1) Weitere Informationen finden Sie in den Erläuterungen in Erläuterung 3.

(2) Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung des Wertpapierbestands.

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

Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC-Finanzderivate und -Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2023 und 31. Dezember 2022:

	Zum 30. Jun. 2023			Zum 31. Dez. 2022		
Kontrahent	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-engagement[1]	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-engagement[1]
AZD	$ 8	$ 0	$ 8	$ k. A.	$ k. A.	$ k. A.
BOA	(1.237)	1.040	(197)	(3.452)	3.430	(22)
BPS	3.426	(1.500)	1.926	(3.383)	3.100	(283)
BRC	(443)	270	(173)	(105)	30	(75)
CBK	148	0	148	287	(540)	(253)
CLY	k. A.	k. A.	k. A.	(20)	0	(20)
FAR	(2.347)	2.270	(77)	(1.707)	1.460	(247)
GLM	(497)	580	83	(15.394)	15.157	(237)

	Zum 30. Jun. 2023			Zum 31. Dez. 2022		
Kontrahent	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-engagement[1]	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-engagement[1]
GST	$ (7)	$ 0	$ (7)	$ (12)	$ 22	$ 10
MBC	4.186	(3.050)	1.136	(1.943)	1.280	(663)
MYC	(2.445)	2.370	(75)	(1.783)	1.490	(293)
MYI	6.264	(4.190)	2.074	510	(320)	190
RBC	17	0	17	(28)	0	(28)
RYL	k. A.	k. A.	k. A.	(25)	0	(25)
SAL	(6)	94	88	(102)	94	(8)
SCX	287	(280)	7	354	(460)	(106)
SSB	(27)	260	233	(2.629)	1.900	(729)
TOR	25	(20)	5	191	(750)	(559)
UAG	470	0	470	42	(20)	22

(1) Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären.

Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung des Wertpapierbestands zum 30. Juni 2023:

	30. Jun. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	57,79	44,59
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	36,29	43,14
Sonstige übertragbare Wertpapiere	0,03	2,68
Investmentfonds	9,68	9,89
Pensionsgeschäfte	8,46	8,83
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	0,31	0,66
Zentral abgerechnete Finanzderivate	(2,10)	(2,52)
Freiverkehrsfinanzderivate	0,70	(2,17)
Leerverkaufte Wertpapiere	(4,07)	(6,99)

Das Anlageportfolio des Fonds konzentriert sich zum 30. Juni 2023 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	30. Jun. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
Kreditbeteiligungen und -abtretung	0,94	2,57
Unternehmensanleihen und Wechsel	25,58	23,54
Kommunalanleihen und Wechsel	0,69	0,56
US-Regierungsbehörden	18,71	14,02
US-Schatzobligationen	17,36	14,38
Non-Agency-MBS	8,52	7,79
Forderungsbesicherte Wertpapiere	19,70	17,36
Staatsemissionen	1,07	2,15
Stammaktien	0,01	0,01
Vorzugswertpapiere	0,01	0,03
Kurzfristige Instrumente	1,52	8,00
Investmentfonds	9,68	9,89
Pensionsgeschäfte	8,46	8,83
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	0,36	0,69
Verkaufsoptionen		
Optionen auf börsengehandelte Terminkontrakte	(0,05)	(0,03)
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	0,00	0,00
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzkauf	(0,25)	(0,15)
Credit Default Swaps auf Kreditindizes— Schutzverkauf	0,00	0,00
Zinsswaps	(1,85)	(2,37)
Freiverkehrsfinanzderivate		
Optionskauf		
Zinsswapoptionen	0,61	0,75
Verkaufsoptionen	k. A.	0,00
Credit Default Swaptions auf Kreditindizes		
Zinsswapoptionen	(1,28)	(2,34)
Optionen auf Wertpapiere	k. A.	(0,01)
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen - Schutzkauf	0,00	0,00
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	0,00	0,00
Credit Default Swaps auf Kreditindizes— Schutzverkauf	0,00	0,00
Zinsswaps	k. A.	0,08
Devisenterminkontrakte	(0,60)	(0,77)
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	1,97	0,12
Leerverkaufte Wertpapiere	(4,07)	(6,99)
Sonstige Aktiva und Passiva	(7,09)	1,89
Nettovermögen	100,00	100,00

BESCHREIBUNG		PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE				
KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG				
Hilton Domestic Operating Co., Inc.				
6,939 % fällig am 22.06.2026	$	20	$ 20	0,40
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
BANKEN UND FINANZEN				
Aflac, Inc.				
1,125 % fällig am 15.03.2026		19	17	0,34
Alexandria Real Estate Equities, Inc.				
2,950 % fällig am 15.03.2034		14	11	0,22
American Tower Corp.				
1,450 % fällig am 15.09.2026		36	32	0,64
Bank of America Corp.				
2,456 % fällig am 22.10.2025		52	50	0,99
Bank of Nova Scotia				
6,050 % fällig am 11.03.2024		48	48	0,96
Citigroup, Inc.				
5,746 % fällig am 25.01.2026		50	50	0,99
Corebridge Financial, Inc.				
3,850 % fällig am 05.04.2029		18	16	0,32
Deutsche Bank AG				
1,375 % fällig am 10.06.2026	€	25	26	0,52
Equinix, Inc.				
1,000 % fällig am 15.09.2025	$	28	25	0,50
1,550 % fällig am 15.03.2028		30	25	0,50
Equitable Financial Life Global Funding				
1,300 % fällig am 12.07.2026		28	24	0,48
Europäische Investitionsbank				
2,375 % fällig am 24.05.2027		67	62	1,23
Goldman Sachs Group, Inc.				
4,387 % fällig am 15.06.2027		49	48	0,96
HAT Holdings LLC				
3,375 % fällig am 15.06.2026		16	14	0,28
HSBC Holdings PLC				
5,750 % fällig am 20.12.2027	£	16	19	0,38
Hudson Pacific Properties LP				
5,950 % fällig am 15.02.2028	$	10	8	0,16
JPMorgan Chase & Co.				
2,947 % fällig am 24.02.2028		52	48	0,96
Manulife Financial Corp.				
3,703 % fällig am 16.03.2032		26	24	0,48
Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc.				
3,741 % fällig am 07.03.2029		50	46	0,92
Mizuho Financial Group, Inc.				
0,214 % fällig am 07.10.2025	€	100	101	2,01
3,490 % fällig am 05.09.2027		100	106	2,11
NatWest Group PLC				
4,067 % fällig am 06.09.2028		100	106	2,11
NTT Finance Corp.				
0,082 % fällig am 13.12.2025	€	100	$ 99	1,97
OneMain Finance Corp.				
6,125 % fällig am 15.03.2024	$	16	16	0,32
Pacific Life Global Funding				
1,375 % fällig am 14.04.2026		19	17	0,34
Radian Group, Inc.				
6,625 % fällig am 15.03.2025		12	12	0,24
Santander Holdings USA, Inc.				
5,807 % fällig am 09.09.2026		30	29	0,58
SBA Communications Corp.				
3,875 % fällig am 15.02.2027		18	17	0,34
Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd.				
5,500 % fällig am 09.03.2028		200	202	4,02
Wells Fargo & Co.				
4,540 % fällig am 15.08.2026		50	49	0,98
Weyerhaeuser Co.				
4,750 % fällig am 15.05.2026		36	35	0,70
			1.382	27,55
INDUSTRIEWERTE				
Ball Corp.				
2,875 % fällig am 15.08.2030		16	13	0,26
Elevance Health, Inc.				
2,550 % fällig am 15.03.2031		28	24	0,48
FactSet Research Systems, Inc.				
3,450 % fällig am 01.03.2032		18	15	0,30
Ford Motor Co.				
6,100 % fällig am 19.08.2032		10	10	0,20
Fraport AG Frankfurt Airport Services Worldwide				
1,875 % fällig am 31.03.2028	€	27	26	0,51
HCA, Inc.				
3,625 % fällig am 15.03.2032	$	28	24	0,48
Hilton Domestic Operating Co., Inc.				
3,625 % fällig am 15.02.2032		20	17	0,34
3,750 % fällig am 01.05.2029		18	16	0,32
MSCI, Inc.				
3,625 % fällig am 01.09.2030		22	19	0,38
Nucor Corp.				
4,300 % fällig am 23.05.2027		10	10	0,20
S&P Global, Inc.				
4,750 % fällig am 01.08.2028		48	48	0,95
VeriSign, Inc.				
2,700 % fällig am 15.06.2031		30	25	0,50
VMware, Inc.				
3,900 % fällig am 21.08.2027		18	17	0,34
Walt Disney Co.				
2,200 % fällig am 13.01.2028		52	47	0,93
Warnermedia Holdings, Inc.				
4,054 % fällig am 15.03.2029		28	26	0,51
Western Digital Corp.				
4,750 % fällig am 15.02.2026	$	16	$ 15	0,30
Xylem, Inc.				
1,950 % fällig am 30.01.2028		30	26	0,52
			378	7,52
VERSORGUNGSUNTERNEHMEN				
AES Corp.				
5,450 % fällig am 01.06.2028		20	20	0,40
Clearway Energy Operating LLC				
3,750 % fällig am 15.02.2031		14	12	0,22
Duke Energy Florida LLC				
2,500 % fällig am 01.12.2029		54	47	0,94
Lumen Technologies, Inc.				
4,000 % fällig am 15.02.2027		18	13	0,26
NextEra Energy Capital Holdings, Inc.				
1,900 % fällig am 15.06.2028		54	46	0,92
Verizon Communications, Inc.				
1,500 % fällig am 18.09.2030		25	20	0,40
Vodafone Group PLC				
5,125 % fällig am 04.06.2081		18	13	0,26
			171	3,40
Summe Unternehmensanleihen und Wechsel			1.931	38,47
US-REGIERUNGSBEHÖRDEN				
Uniform Mortgage-Backed Security, TBA				
3,000 % fällig am 01.08.2053		80	70	1,40
3,500 % fällig am 01.08.2053		220	201	4,01
4,000 % fällig am 01.08.2053		100	94	1,87
5,000 % fällig am 01.09.2053		300	294	5,86
			659	13,14
FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE				
St. Paul's CLO DAC				
3,927 % fällig am 15.01.2032	€	100	107	2,13
KURZFRISTIGE INSTRUMENTE				
U.S. TREASURY BILLS				
5,151 % fällig am 20.07.2023 (b)(c)	$	400	399	7,95
5,156 % fällig am 03.08.2023 (b)(c)		100	100	1,99
5,177 % fällig am 15.08.2023 (b)(c)		1.100	1.093	21,80
5,207 % fällig am 10.08.2023 (b)(c)		100	100	1,99
5,259 % fällig am 17.08.2023 (a)(b)(c)		100	99	1,98
5,290 % fällig am 24.08.2023 (b)(c)		100	99	1,97
5,339 % fällig am 31.08.2023 (b)(c)		800	793	15,81
			2.683	53,49
Summe kurzfristige Instrumente			2.683	53,49
Summe Übertragbare Wertpapiere			**$ 5.400**	**107,63**

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

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

FUTURES

Beschreibung	Art	Ablauf-monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Euro-Bobl September Futures	Short	09.2023	1	$ 2	0,03
Euro-Bund 10-Year Bond September Futures	Short	09.2023	1	1	0,03
Euro-Schatz September Futures	Short	09.2023	2	2	0,04
U.S. Treasury 2-Year Note September Futures	Long	09.2023	2	(6)	(0,12)
U.S. Treasury 5-Year Note September Futures	Long	09.2023	11	(23)	(0,46)
U.S. Treasury 10-Year Note September Futures	Short	09.2023	7	12	0,24
U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond September Futures	Short	09.2023	2	(3)	(0,06)
				$ (15)	(0,30)
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate				**$ (15)**	**(0,30)**

ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)

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

ZINSSWAPS

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Zahlung	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	3,500 %	20.09.2033	£ 150	$ (8)	(0,18)
Erhalt	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	3,750	20.09.2028	100	6	0,12
Zahlung	3-Month CAD-Bank Bill	2,060	28.10.2023	CAD 600	0	0,00
Zahlung	3-Month CAD-CAONREPO Compounded-OIS	4,000	21.06.2025	500	(4)	(0,07)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	3,000	20.09.2033	€ 100	0	0,01
					$ (6)	(0,12)
Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate					**$ (6)**	**(0,12)**

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

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

DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	08.2023	$ 14	AUD 21	$ 0	$ 0	$ 0	(0,01)
	08.2023	3	€ 3	0	0	0	0,00
BRC	08.2023	£ 13	$ 16	0	0	0	(0,01)
	08.2023	$ 15	¥ 1.938	0	(1)	(1)	(0,02)
CBK	08.2023	CAD 14	$ 10	0	0	0	0,00
	08.2023	€ 3	3	0	0	0	0,00
	08.2023	$ 2	¥ 319	0	0	0	0,00
GLM	08.2023	CAD 4	$ 3	0	0	0	0,00
MBC	08.2023	€ 620	684	6	0	6	0,14
MYI	08.2023	$ 31	¥ 4.165	0	(3)	(3)	(0,05)
RYL	08.2023	£ 2	$ 3	0	0	0	0,00
UAG	08.2023	7	9	0	0	0	0,00
				$ 6	$ (4)	$ 2	0,05

ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklassen Institutional EUR (Hedged) thesaurierend und Institutional EUR (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2023	$ 84	€ 78	$ 1	$ 0	$ 1	0,03
CBK	07.2023	€ 79	$ 86	0	0	0	(0,01)
	08.2023	$ 85	€ 78	0	0	0	0,01
MBC	07.2023	84	79	2	0	2	0,03
SCX	07.2023	84	79	2	0	2	0,03
				$ 5	$ 0	$ 5	0,09

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklassen Institutional GBP (Hedged) thesaurierend und Institutional GBP (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
MBC	07.2023	$ 84	£ 68	$ 2	$ 0	$ 2	0,05
MYI	07.2023	84	68	2	0	2	0,04
UAG	07.2023	86	69	2	0	2	0,03
				$ 6	$ 0	$ 6	0,12
Summe Freiverkehrsfinanzderivate						**$ 13**	**0,26**
Summe Anlagen						**$ 5.392**	**107,47**
Sonstige Aktiva und Passiva						**$ (375)**	**(7,47)**
Nettovermögen						**$ 5.017**	**100,00**

ERLÄUTERUNGEN ZUR AUFSTELLUNG DES WERTPAPIERBESTANDS (Angaben in Tausend*):

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

(a) **Wertpapier per Emissionstermin.**

(b) **Nullkuponwertpapier.**

(c) **Der Kupon stellt eine Rendite bis zur Endfälligkeit dar.**

Barmittel in Höhe von 50 USD (31. Dezember 2022: 31 USD) wurden zum 30. Juni 2023 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Beizulegender Zeitwert[1]

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 30. Juni 2023 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie[2]	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	$ 0	$ 5.400	$ 0	$ 5.400
Finanzderivate[3]	5	(13)	0	(8)
Summen	**$ 5**	**$ 5.387**	**$ 0**	**$ 5.392**

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

Kategorie[2]	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	$ 0	$ 5.070	$ 0	$ 5.070
Finanzderivate[3]	(4)	(41)	0	(45)
Summen	**$ (4)**	**$ 5.029**	**$ 0**	**$ 5.025**

(1) Weitere Informationen finden Sie in den Erläuterungen in Erläuterung 3.

(2) Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung des Wertpapierbestands.

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

Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC-Finanzderivate und -Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2023 und 31. Dezember 2022:

	Zum 30. Jun. 2023			Zum 31. Dez. 2022		
Kontrahent	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-engagement[1]	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-engagement[1]
BOA	$ 1	$ 0	$ 1	$ 4	$ 0	$ 4
BRC	(1)	0	(1)	(8)	0	(8)
CBK	k. A.	k. A.	k. A.	(8)	0	(8)
GLM	k. A.	k. A.	k. A.	2	0	2
MBC	10	0	10	k. A.	k. A.	k. A.
MYI	(1)	0	(1)	(11)	0	(11)
SCX	2	0	2	(16)	0	(16)
UAG	2	0	2	k. A.	k. A.	k. A.

(1) Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären.

Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung des Wertpapierbestands zum 30. Juni 2023:

	30. Jun. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	88,08	32,23
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	19,55	70,65
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	(0,30)	(0,18)
Zentral abgerechnete Finanzderivate	(0,12)	0,02
Freiverkehrsfinanzderivate	0,26	(0,75)

Das Anlageportfolio des Fonds konzentriert sich zum 30. Juni 2023 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	30. Jun. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
Kreditbeteiligungen und -abtretung	0,40	1,53
Unternehmensanleihen und Wechsel	38,47	34,48
US-Regierungsbehörden	13,14	5,49
Forderungsbesicherte Wertpapiere	2,13	2,12
Kurzfristige Instrumente	53,49	59,26
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	(0,30)	(0,18)
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Zinsswaps	(0,12)	0,02
Freiverkehrsfinanzderivate		
Devisenterminkontrakte	0,05	(0,87)
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	0,21	0,12
Sonstige Aktiva und Passiva	(7,47)	(1,97)
Nettovermögen	100,00	100,00

Aufstellung des Wertpapierbestands des PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund

BESCHREIBUNG	AKTIEN	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE			
KANADA			
STAMMAKTIEN			
Enbridge, Inc.	29.800	$ 1.109	1,14
Pembina Pipeline Corp.	75.700	2.383	2,45
TC Energy Corp.	29.720	1.202	1,24
Summe Kanada		4.694	4,83
USA			
STAMMAKTIEN			
ENERGIE			
Antero Midstream Corp.	107.900	1.252	1,29
Cheniere Energy, Inc.	31.133	4.743	4,88
Chesapeake Energy Corp.	34.400	2.879	2,96
ConocoPhillips	16.700	1.730	1,78
Devon Energy Corp.	30.200	1.460	1,50
DTE Midstream LLC	84.900	4.208	4,33
EnLink Midstream LLC	225.400	2.389	2,46
EOG Resources, Inc.	8.700	996	1,03
EQT Corp.	60.700	$ 2.497	2,57
Equitrans Midstream Corp.	105.200	1.006	1,04
Hess Midstream LP 'A'	22.700	696	0,72
Kinder Morgan, Inc.	125.600	2.163	2,23
Marathon Oil Corp.	58.500	1.347	1,39
Occidental Petroleum Corp.	26.066	1.533	1,58
ONEOK, Inc.	55.730	3.440	3,54
Pioneer Natural Resources Co.	11.200	2.320	2,39
Targa Resources Corp.	67.700	5.152	5,31
Williams Cos., Inc.	148.100	4.832	4,98
Summe USA		44.643	45,98

BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
KURZFRISTIGE INSTRUMENTE			
KURZFRISTIGE SCHULDTITEL			
Federal Home Loan Bank 5,100 % fällig am 25.08.2023	$ 2.000	2.000	2,06
U.S. TREASURY BILLS			
5,156 % fällig am 03.08.2023 (a)(b)	$ 1.800	$ 1.792	1,85
5,177 % fällig am 15.08.2023 (a)(b)	28.400	28.225	29,07
5,239 % fällig am 07.09.2023 (a)(b)	1.800	1.783	1,84
5,242 % fällig am 20.07.2023 (a)(b)	3.100	3.093	3,18
		34.893	35,94
Summe kurzfristige Instrumente		36.893	38,00
Summe Übertragbare Wertpapiere		**$ 86.230**	**88,81**

	AKTIEN		
INVESTMENTFONDS			
ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN			
PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (c)	939.277	9.353	9,63
Summe Investmentfonds		**$ 9.353**	**9,63**

PENSIONSGESCHÄFTE

Kontrahent	Kredit-zins	Abrechnungs-datum	Fälligkeits-datum	Kapital-betrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensions-geschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensions-geschäft[1]	% des Nettovermögens
SSB	2,400 %	30.06.2023	03.07.2023	$ 840	U.S. Treasury Notes 1,875 % fällig am 30.06.2026	$ (857)	$ 840	$ 840	0,87
Summe Pensionsgeschäfte						**$ (857)**	**$ 840**	**$ 840**	**0,87**

[1] Umfasst aufgelaufene Zinsen.

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

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

TOTAL RETURN SWAPS AUF INDIZES

Kontrahent	Zahlung/Erhalt	Wertpapier	Anzahl der Anteile oder Einheiten	Variabler Zinssatz	Nenn-betrag	Fälligkeits-datum	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Markt-wert	% des Nettovermögens
BPS	Erhalt	AMZX Index	1.179	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	$ 1.851	11.10.2023	$ 0	$ 69	$ 69	0,07

TOTAL RETURN SWAPS AUF WERTPAPIERE

Kontrahent	Zahlung/Erhalt	Wertpapier	Anzahl der Anteile oder Einheiten	Variabler Zinssatz	Nenn-betrag	Fälligkeits-datum	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Markt-wert	% des Nettovermögens
BOA	Erhalt	Energy Transfer LP	241.320	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	$ 3.074	11.10.2023	$ 0	$ (9)	$ (9)	(0,01)
	Erhalt	MPLX LP	212.600	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	7.088	15.11.2023	0	96	96	0,10
	Erhalt	Plains All American Pipeline LP	186.056	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	2.404	15.11.2023	0	209	209	0,22
	Erhalt	Sunoco LP	60.200	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	2.588	15.11.2023	0	23	23	0,03
	Erhalt	Energy Transfer LP	242.369	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	3.005	17.01.2024	0	59	59	0,06
	Erhalt	Enterprise Products Partners LP	260.070	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	6.588	17.01.2024	0	236	236	0,24
	Erhalt	Western Midstream Partners LP	121.461	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	3.066	17.01.2024	0	142	142	0,15
CBK	Erhalt	Energy Transfer LP	205.784	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	2.622	11.10.2023	0	(9)	(9)	(0,01)
FAR	Erhalt	Crestwood Equity Partners LP	56.900	1-Month USD-LIBOR abzgl. eines bestimmten Spreads	1.460	06.09.2023	0	46	46	0,05
	Erhalt	Crestwood Equity Partners LP	41.700	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	1.070	06.09.2023	0	30	30	0,03
JPM	Erhalt	Crestwood Equity Partners LP	13.000	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	334	06.09.2023	0	9	9	0,01
MYI	Erhalt	Enterprise Products Partners LP	25.000	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	656	11.10.2023	0	3	3	0,00
	Erhalt	Western Midstream Partners LP	77.089	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	2.032	11.10.2023	0	12	12	0,01
	Erhalt	Western Midstream Partners LP	68.832	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	1.737	15.11.2023	0	80	80	0,08

Kontrahent	Zahlung/Erhalt	Wertpapier	Anzahl der Anteile oder Einheiten	Variabler Zinssatz	Nenn-betrag	Fälligkeits-datum	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Markt-wert	% des Nettovermögens
	Erhalt	Plains All American Pipeline LP	426.400	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	$ 5.509	17.01.2024	$ 0	$ 478	$ 478	0,49
							$ 0	$ 1.405	$ 1.405	1,45

DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2023	CAD 8.737	$ 6.421	$ 0	$ (182)	$ (182)	(0,19)
BPS	08.2023	$ 163	€ 149	0	0	0	0,00
BRC	08.2023	€ 110	$ 120	0	0	0	0,00
MBC	07.2023	$ 1.467	CAD 1.977	27	0	27	0,03
	07.2023	110	£ 89	3	0	3	0,00
MYI	07.2023	49	€ 45	0	0	0	0,00
TOR	07.2023	£ 89	$ 113	0	0	0	0,00
	07.2023	$ 5.109	CAD 6.760	4	(4)	0	0,00
	08.2023	CAD 6.758	$ 5.109	4	(4)	0	0,00
	08.2023	$ 113	£ 89	0	0	0	0,00
				$ 38	$ (190)	$ (152)	(0,16)

ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklassen Institutional EUR (Hedged) thesaurierend und Institutional EUR (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2023	€ 995	$ 1.076	$ 0	$ (9)	$ (9)	(0,01)
	07.2023	$ 14.006	€ 13.032	213	0	213	0,22
BPS	07.2023	€ 12.765	$ 13.986	59	0	59	0,06
	07.2023	$ 14.010	€ 13.032	208	0	208	0,21
	08.2023	13.653	12.443	0	(60)	(60)	(0,06)
CBK	07.2023	€ 13.530	$ 14.710	3	(55)	(52)	(0,05)
	08.2023	$ 12.357	€ 11.349	43	0	43	0,04
JPM	07.2023	€ 12.553	$ 13.707	11	0	11	0,01
	08.2023	$ 13.726	€ 12.553	0	(12)	(12)	(0,01)
MBC	07.2023	€ 789	$ 852	2	(10)	(8)	(0,01)
	07.2023	$ 1.650	€ 1.533	22	0	22	0,02
SOG	07.2023	14.020	13.032	199	0	199	0,21
				$ 760	$ (146)	$ 614	0,63

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklasse Institutional GBP (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2023	£ 40	$ 50	$ 0	$ 0	$ 0	0,00
BPS	07.2023	$ 571	£ 462	16	0	16	0,02
CBK	07.2023	58	46	1	0	1	0,00
JPM	07.2023	£ 479	$ 605	0	(3)	(3)	0,00
	08.2023	$ 605	£ 479	3	0	3	0,00
MBC	07.2023	£ 0	$ 0	0	0	0	0,00
	07.2023	$ 570	£ 460	15	0	15	0,02
MYI	07.2023	572	460	13	0	13	0,01
TOR	07.2023	£ 476	$ 604	0	0	0	0,00
	08.2023	$ 604	£ 476	0	0	0	0,00
				$ 48	$ (3)	$ 45	0,05

Summe Freiverkehrsfinanzderivate	**$ 1.981**	**2,04**
Summe Anlagen	**$ 98.404**	**101,35**
Sonstige Aktiva und Passiva	**$ (1.313)**	**(1,35)**
Nettovermögen	**$ 97.091**	**100,00**

ERLÄUTERUNGEN ZUR AUFSTELLUNG DES WERTPAPIERBESTANDS (Angaben in Tausend*):

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

(a) **Nullkuponwertpapier.**

(b) **Der Kupon stellt eine Rendite bis zur Endfälligkeit dar.**

(c) **Mit dem Fonds verbunden.**

Barmittel in Höhe von null USD (31. Dezember 2022: 2.870 USD) wurden zum 30. Juni 2023 gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. als Sicherheit für Finanzderivate verpfändet.

Beizulegender Zeitwert[1]

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 30. Juni 2023 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie[2]	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	$ 49.337	$ 36.893	$ 0	$ 86.230
Investmentfonds	9.353	0	0	9.353
Pensionsgeschäfte	0	840	0	840
Finanzderivate[3]	0	1.981	0	1.981
Summen	**$ 58.690**	**$ 39.714**	**$ 0**	**$ 98.404**

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

Kategorie[2]	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	$ 64.970	$ 41.989	$ 0	$ 106.959
Investmentfonds	11.833	0	0	11.833
Pensionsgeschäfte	0	811	0	811
Finanzderivate[3]	0	1.210	0	1.210
Summen	**$ 76.803**	**$ 44.010**	**$ 0**	**$ 120.813**

(1) Weitere Informationen finden Sie in den Erläuterungen in Erläuterung 3.

(2) Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung des Wertpapierbestands.

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

Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC-Finanzderivate und -Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2023 und 31. Dezember 2022:

	Zum 30. Jun. 2023			Zum 31. Dez. 2022		
Kontrahent	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-engagement[1]	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-engagement[1]
BOA	$ 778	$ (820)	$ (42)	$ (129)	$ 1.610	$ 1.481
BPS	292	(320)	(28)	k. A.	k. A.	k. A.
CBK	(17)	0	(17)	488	(370)	118
FAR	76	0	76	(18)	550	532
JPM	8	0	8	18	0	18
MBC	59	0	59	305	(310)	(5)
MYI	586	(340)	246	17	710	727
SOG	199	(270)	(71)	466	(270)	196
TOR	k. A.	k. A.	k. A.	63	0	63

(1) Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären.

Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung des Wertpapierbestands zum 30. Juni 2023:

	30. Jun. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	86,75	54,07
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	2,06	34,95
Investmentfonds	9,63	9,85
Pensionsgeschäfte	0,87	0,68
Freiverkehrsfinanzderivate	2,04	1,01

Das Anlageportfolio des Fonds konzentriert sich zum 30. Juni 2023 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	30. Jun. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
Kanada	4,83	9,07
USA	45,98	45,00
Kurzfristige Instrumente	38,00	34,95
Investmentfonds	9,63	9,85
Pensionsgeschäfte	0,87	0,68
Freiverkehrsfinanzderivate		
Total Return Swaps auf Indizes	0,07	(0,01)
Total Return Swaps auf Wertpapiere	1,45	(0,10)
Devisenterminkontrakte	(0,16)	0,08
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	0,68	1,04
Sonstige Aktiva und Passiva	(1,35)	(0,56)
Nettovermögen	100,00	100,00

BESCHREIBUNG		PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
BANKEN UND FINANZEN				
SLM Student Loan Trust				
4,076 % fällig am 15.12.2033	€	643	$ 647	0,10
INDUSTRIEWERTE				
Times Square Hotel Trust				
8,528 % fällig am 01.08.2026	$	92	91	0,02
Summe Unternehmensanleihen und Wechsel			738	0,12
US-REGIERUNGSBEHÖRDEN				
Fannie Mae				
0,000 % fällig am 25.03.2033 - 25.03.2047		3.274	2.214	0,36
0,000 % fällig am 25.05.2033 - 25.05.2048 (b)(d)		4.050	3.075	0,50
0,000 % fällig am 25.06.2043 - 25.02.2062 (a)		252.279	5.515	0,89
0,200 % fällig am 25.02.2043 (a)		2.387	17	0,00
0,573 % fällig am 25.08.2033		259	227	0,04
0,639 % fällig am 25.08.2033		78	68	0,01
0,800 % fällig am 25.04.2044 (a)		1.487	144	0,02
0,850 % fällig am 25.05.2046 - 25.01.2050 (a)		20.006	2.225	0,36
0,900 % fällig am 25.10.2042 - 25.07.2059 (a)		11.902	1.354	0,22
0,950 % fällig am 25.06.2037 - 25.07.2050 (a)		18.706	1.966	0,32
1,000 % fällig am 25.02.2046 - 25.09.2048 (a)		8.513	961	0,16
1,050 % fällig am 25.11.2047 - 25.06.2048 (a)		28.627	3.141	0,51
1,074 % fällig am 25.07.2023		0	0	0,00
1,100 % fällig am 25.04.2043 (a)		1.938	106	0,02
1,150 % fällig am 25.05.2030 (a)		1.453	57	0,01
1,380 % fällig am 25.01.2041 (a)		539	60	0,01
1,450 % fällig am 25.09.2040 - 25.09.2042 (a)		3.291	249	0,04
1,500 % fällig am 25.05.2034 (a)		314	3	0,00
1,650 % fällig am 25.12.2032 (a)		468	40	0,01
1,950 % fällig am 25.11.2033 - 25.10.2034 (a)		704	36	0,01
2,000 % fällig am 25.10.2050 - 25.04.2052 (a)		7.700	924	0,15
2,050 % fällig am 25.10.2042 (a)		424	53	0,01
2,450 % fällig am 25.11.2033 (a)		45	3	0,00
2,500 % fällig am 25.12.2027 - 25.09.2051 (a)		75.587	10.474	1,69
3,000 % fällig am 25.11.2027 - 25.01.2051 (a)		47.848	6.926	1,12
3,000 % fällig am 01.02.2057 - 01.07.2060 (h)		23.850	20.775	3,35
3,500 % fällig am 25.02.2028 - 25.11.2047 (a)		22.933	3.500	0,56
3,510 % fällig am 01.03.2029 (h)		1.106	1.050	0,17
3,523 % fällig am 01.08.2049 (h)		588	581	0,09
3,668 % fällig am 01.12.2048 (h)		549	549	0,09
3,870 % fällig am 01.07.2027 (h)		1.600	1.521	0,25
4,000 % fällig am 25.04.2032 - 25.06.2050 (a)		27.033	4.516	0,73
4,000 % fällig am 25.05.2050		1.999	1.817	0,29
4,042 % fällig am 25.05.2051 (a)		2.905	457	0,07
4,140 % fällig am 01.04.2028		677	661	0,11
4,374 % fällig am 01.02.2028		2.000	1.950	0,31
4,385 % fällig am 01.04.2033		718	713	0,12
4,440 % fällig am 01.06.2033		1.573	1.572	0,25
4,490 % fällig am 01.04.2033		300	300	0,05
4,500 % fällig am 25.06.2029 - 25.07.2050 (a)		5.648	834	0,13
4,500 % fällig am 01.11.2032		2.000	2.004	0,32
4,500 % fällig am 01.04.2059 (h)		4.408	4.265	0,69
4,700 % fällig am 01.04.2033		1.410	1.419	0,23
4,990 % fällig am 01.03.2031 (c)		500	505	0,08
5,000 % fällig am 25.04.2034 - 25.12.2035 (a)		950	165	0,03
5,500 % fällig am 25.06.2035 - 25.02.2040 (a)		1.986	397	0,06
5,620 % fällig am 01.06.2041 (h)		468	481	0,08
6,000 % fällig am 25.04.2032 - 25.03.2033 (a)		295	44	0,01
6,500 % fällig am 25.12.2034 (a)	$	1.299	$ 197	0,03
Freddie Mac				
0,000 % fällig am 15.10.2032 - 15.12.2048		3.003	2.030	0,33
0,000 % fällig am 01.02.2035 - 15.08.2057 (b)(d)		3.479	2.573	0,41
0,000 % fällig am 15.01.2038 - 15.08.2047 (a)		21.288	1.121	0,18
0,505 % fällig am 25.08.2024 (a)		55.718	225	0,04
0,657 % fällig am 15.02.2041 (a)		276	20	0,00
0,697 % fällig am 15.09.2043 (a)		747	67	0,01
0,757 % fällig am 15.07.2041 (a)		2.514	180	0,03
0,807 % fällig am 15.10.2041 - 15.08.2042 (a)		10.746	1.075	0,17
0,857 % fällig am 15.08.2041 - 15.09.2044 (a)		7.495	694	0,11
0,900 % fällig am 25.11.2049 - 25.06.2050 (a)		26.412	2.720	0,44
0,907 % fällig am 15.02.2044 (a)		125	6	0,00
0,950 % fällig am 25.06.2050 (a)		16.878	1.898	0,31
0,957 % fällig am 15.08.2025 - 15.10.2048 (a)		12.392	1.374	0,22
1,000 % fällig am 25.05.2050 (a)		2.990	334	0,05
1,007 % fällig am 15.03.2048 (a)		3.247	380	0,06
1,057 % fällig am 15.09.2042 (a)		934	62	0,01
1,107 % fällig am 15.10.2036 (a)		1.074	70	0,01
1,277 % fällig am 15.11.2037 (a)		220	15	0,00
1,297 % fällig am 15.01.2042 (a)		5.810	614	0,10
1,407 % fällig am 15.11.2041 (a)		140	6	0,00
1,457 % fällig am 15.07.2026 (a)		502	8	0,00
1,507 % fällig am 15.09.2026 - 15.12.2042 (a)		1.782	173	0,03
1,537 % fällig am 15.09.2039 (a)		2.505	230	0,04
1,657 % fällig am 15.03.2038 (a)		462	35	0,01
2,000 % fällig am 25.11.2050 - 15.06.2052 (a)		22.646	2.711	0,44
2,500 % fällig am 15.11.2027 - 15.10.2052 (a)		54.677	7.156	1,15
2,532 % fällig am 15.09.2032		268	251	0,04
2,707 % fällig am 15.12.2031 (a)		51	5	0,00
2,920 % fällig am 01.09.2036 (h)		1.328	1.096	0,18
3,000 % fällig am 15.03.2027 - 25.06.2051 (a)		91.849	13.349	2,15
3,000 % fällig am 15.12.2046 - 15.04.2049 (a)		964	140	0,02
3,314 % fällig am 15.12.2027 (a)		505	24	0,00
3,500 % fällig am 15.03.2029 - 25.03.2052 (a)		31.718	5.047	0,81
3,500 % fällig am 01.01.2038 - 01.11.2046 (h)		878	824	0,13
3,500 % fällig am 01.12.2046		54	51	0,01
3,554 % fällig am 25.09.2024		6.100	5.536	0,89
4,000 % fällig am 15.10.2041 - 25.08.2050 (a)		24.808	5.338	0,86
4,000 % fällig am 01.03.2046 - 01.03.2048 (h)		10.209	9.774	1,58
4,000 % fällig am 01.04.2048		135	129	0,02
4,500 % fällig am 15.02.2037 - 25.10.2051 (a)		7.102	1.081	0,17
4,500 % fällig am 01.02.2048 (h)		534	523	0,08
4,660 % fällig am 25.01.2031		2.200	2.175	0,35
5,000 % fällig am 15.05.2025 - 25.05.2048 (a)		1.770	293	0,05
5,000 % fällig am 01.03.2049 (h)		2.659	2.653	0,43
5,220 % fällig am 25.12.2036		7.074	5.619	0,91
Ginnie Mae				
0,000 % fällig am 20.08.2033 - 20.01.2044 (b)(d)		1.898	1.700	0,27
0,000 % fällig am 20.05.2040 - 20.08.2047 (a)		57.685	1.873	0,30
0,000 % fällig am 20.11.2045		534	344	0,06
0,404 % fällig am 20.09.2043 (a)		1.053	15	0,00
0,563 % fällig am 20.09.2045 (a)		1.979	133	0,02
0,892 % fällig am 16.04.2040 - 16.08.2042 (a)		2.836	214	0,03
0,943 % fällig am 20.12.2048 - 20.08.2049 (a)		7.502	545	0,09
0,954 % fällig am 20.01.2035 (a)		1.897	55	0,01
1,043 % fällig am 20.03.2035 - 20.09.2048 (a)		864	89	0,01
1,054 % fällig am 20.12.2047 (a)		1.159	118	0,02
1,093 % fällig am 20.07.2044 (a)		2.278	322	0,05
1,242 % fällig am 16.01.2038 (a)		19	0	0,00
1,292 % fällig am 16.02.2040 (a)	$	1.679	$ 98	0,02
1,554 % fällig am 20.05.2041 (a)		1.357	74	0,01
2,500 % fällig am 20.09.2027 (a)		3.118	118	0,02
3,000 % fällig am 20.12.2047 - 20.04.2050 (h)		7.245	6.548	1,06
3,000 % fällig am 20.12.2049 - 20.02.2052 (a)		12.836	1.411	0,23
3,000 % fällig am 20.10.2051		211	189	0,03
3,250 % fällig am 20.01.2047 (h)		441	392	0,06
3,500 % fällig am 20.09.2029 - 20.09.2046 (a)		1.344	196	0,03
3,500 % fällig am 20.03.2042 - 20.11.2052		2.191	1.882	0,30
3,500 % fällig am 20.06.2042 - 20.12.2052 (h)		17.799	16.533	2,67
4,000 % fällig am 15.04.2047		849	818	0,13
4,000 % fällig am 15.06.2047 - 15.08.2048 (h)		1.620	1.555	0,25
4,500 % fällig am 20.05.2043 - 20.09.2047 (a)		2.716	525	0,08
4,500 % fällig am 20.04.2048 - 20.02.2049		696	678	0,11
4,500 % fällig am 20.05.2048 (h)		1.367	1.323	0,21
5,000 % fällig am 20.09.2040 (a)		447	0	0,00
5,000 % fällig am 20.11.2048 (h)		946	938	0,15
5,352 % fällig am 20.03.2058 (h)		136	135	0,02
6,000 % fällig am 20.02.2047 (h)		15	16	0,00
6,150 % fällig am 20.06.2073		600	601	0,10
Ginnie Mae, TBA				
3,000 % fällig am 01.08.2053		10.700	9.571	1,54
3,500 % fällig am 01.08.2053		3.950	3.650	0,59
4,500 % fällig am 01.08.2053		6.620	6.393	1,03
Uniform Mortgage-Backed Security				
2,500 % fällig am 01.01.2033 - 01.09.2051 (h)		18.221	15.660	2,52
3,000 % fällig am 01.01.2038 - 01.07.2052 (h)		57.296	51.324	8,27
3,000 % fällig am 01.12.2049 - 01.03.2051		776	690	0,11
3,500 % fällig am 01.02.2030		106	101	0,02
3,500 % fällig am 01.10.2034 - 01.06.2052 (h)		44.146	41.192	6,64
4,000 % fällig am 01.02.2037 - 01.08.2049 (h)		23.415	22.458	3,62
4,000 % fällig am 01.09.2042 - 01.05.2053		95.196	89.410	14,41
4,500 % fällig am 01.12.2038 - 01.03.2053 (h)		150.451	144.840	23,35
4,500 % fällig am 01.12.2044 - 01.04.2053		13.982	13.451	2,17
5,000 % fällig am 01.06.2048 - 01.03.2049 (h)		803	801	0,13
5,000 % fällig am 01.06.2053		114.926	112.676	18,16
6,000 % fällig am 01.05.2053		10.822	10.922	1,76
Uniform Mortgage-Backed Security, TBA				
3,500 % fällig am 01.07.2038 - 01.07.2053		3.400	3.197	0,52
4,500 % fällig am 01.07.2038		23.500	23.043	3,71
5,000 % fällig am 01.07.2038 - 01.07.2053		14.500	14.306	2,31
5,500 % fällig am 01.07.2053		66.200	65.876	10,62
6,000 % fällig am 01.08.2053		108.600	109.521	17,66
6,500 % fällig am 01.07.2053		74.400	75.969	12,25
			1.024.285	165,12
US-SCHATZOBLIGATIONEN				
U.S. Treasury Inflation Protected Securities (f)				
0,125 % fällig am 15.07.2024		128	124	0,02
0,125 % fällig am 15.10.2024 (h)		946	912	0,15
0,500 % fällig am 15.04.2024 (h)		1.118	1.092	0,17
0,625 % fällig am 15.01.2024 (h)		4.836	4.754	0,77
			6.882	1,11
NON-AGENCY-MBS				
1166 Avenue of the Americas Commercial Mortgage Trust				
5,690 % fällig am 13.10.2037		2.000	1.582	0,25
225 Liberty Street Trust				
4,803 % fällig am 10.02.2036		5.000	3.965	0,64
American Home Mortgage Assets Trust				
5,275 % fällig am 25.03.2047		2.102	1.868	0,30

BESCHREIBUNG		PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
American Home Mortgage Investment Trust				
5,730 % fällig am 25.11.2045	$	1.839	$ 1.624	0,26
5,883 % fällig am 25.09.2035		576	318	0,05
6,500 % fällig am 25.03.2047		1.172	872	0,14
Angel Oak Mortgage Trust				
2,336 % fällig am 25.04.2066		3.638	2.120	0,34
Ashford Hospitality Trust				
8,069 % fällig am 15.06.2035		6.900	6.530	1,05
Atlas Funding PLC				
6,232 % fällig am 25.07.2058	£	1.150	1.456	0,23
6,782 % fällig am 25.07.2058		950	1.201	0,19
Banc of America Funding Trust				
5,763 % fällig am 25.10.2036	$	1.666	1.448	0,23
Barley Hill PLC				
6,604 % fällig am 27.08.2058	£	2.953	3.623	0,58
BCAP LLC Trust				
5,430 % fällig am 25.04.2037	$	1.547	1.402	0,23
Bear Stearns ALT-A Trust				
6,275 % fällig am 25.01.2035		1.413	1.306	0,21
Cascade Funding Mortgage Trust				
4,000 % fällig am 25.10.2068		828	802	0,13
Chase Mortgage Finance Trust				
4,086 % fällig am 25.03.2037 ^		49	45	0,01
ChaseFlex Trust				
5,830 % fällig am 25.05.2037		1.550	1.469	0,24
Citigroup Mortgage Loan Trust				
6,000 % fällig am 25.12.2035		1.255	1.188	0,19
Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.				
4,189 % fällig am 25.08.2035		16	15	0,00
CitiMortgage Alternative Loan Trust				
5,700 % fällig am 25.01.2037		1.479	1.216	0,20
6,000 % fällig am 25.11.2036		897	801	0,13
Countrywide Alternative Loan Trust				
4,916 % fällig am 25.06.2046		2.058	1.660	0,27
4,976 % fällig am 25.12.2035		1.223	1.091	0,18
5,470 % fällig am 25.02.2047		283	257	0,04
5,470 % fällig am 25.09.2047		8	7	0,00
5,500 % fällig am 25.06.2035		142	113	0,02
5,500 % fällig am 25.07.2035		2.061	1.486	0,24
5,500 % fällig am 25.10.2035		1.151	832	0,13
5,500 % fällig am 25.11.2035 ^		1.701	996	0,16
5,500 % fällig am 25.12.2035		237	169	0,03
5,577 % fällig am 20.03.2046		497	407	0,07
5,577 % fällig am 20.05.2046 ^		1.813	1.539	0,25
5,790 % fällig am 25.11.2035		3.966	3.189	0,51
5,850 % fällig am 25.09.2035		1.777	1.607	0,26
6,000 % fällig am 25.05.2036		3.510	2.094	0,34
6,000 % fällig am 25.02.2037 ^		1.386	605	0,10
6,250 % fällig am 25.05.2036		272	155	0,02
6,250 % fällig am 25.09.2037		509	347	0,06
Countrywide Asset-Backed Certificates				
5,650 % fällig am 25.03.2036		478	478	0,08
Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust				
3,514 % fällig am 25.04.2035 ^		206	158	0,03
3,666 % fällig am 20.11.2035		3.238	2.898	0,47
3,797 % fällig am 20.04.2036		43	37	0,01
4,221 % fällig am 20.04.2036		558	479	0,08
5,750 % fällig am 25.07.2037 ^		728	380	0,06
6,500 % fällig am 25.11.2037 ^		2.231	860	0,14
6,500 % fällig am 25.12.2037		5.240	2.304	0,37
Credit Suisse Mortgage Capital Mortgage-Backed Trust				
5,500 % fällig am 25.10.2021		15	13	0,00
DBGS Mortgage Trust				
6,743 % fällig am 15.06.2033		2.422	2.097	0,34
Downey Savings & Loan Association Mortgage Loan Trust				
5,347 % fällig am 19.10.2036		4.590	3.807	0,61
Eurosail PLC				
3,709 % fällig am 13.03.2045	€	550	574	0,09
3,936 % fällig am 10.09.2044		800	823	0,13
5,540 % fällig am 13.06.2045	£	1.673	1.821	0,29
5,989 % fällig am 13.06.2045		309	358	0,06
First Horizon Alternative Mortgage Securities Trust				
6,084 % fällig am 25.07.2035	$	182	166	0,03
Grifonas Finance PLC				
3,513 % fällig am 28.08.2039	€	903	939	0,15
GS Mortgage Securities Corp. Trust				
4,579 % fällig am 10.10.2032	$	5.821	5.546	0,89
6,643 % fällig am 15.07.2031	$	600	$ 503	0,08
6,893 % fällig am 15.07.2031		2.000	1.582	0,25
GS Mortgage Securities Trust				
3,932 % fällig am 10.10.2035		3.700	3.164	0,51
GSMPS Mortgage Loan Trust				
5,550 % fällig am 25.04.2036		345	283	0,05
7,059 % fällig am 20.10.2032		1.220	1.063	0,17
GSMSC Resecuritization Trust				
3,126 % fällig am 26.04.2037		7.355	2.043	0,33
Hops Hill PLC				
6,754 % fällig am 27.05.2054	£	3.000	3.799	0,61
7,254 % fällig am 27.05.2054		1.100	1.373	0,22
HSI Asset Securitization Corp. Trust				
6,110 % fällig am 25.07.2035	$	1.100	1.044	0,17
IndyMac Mortgage Loan Trust				
3,587 % fällig am 25.12.2035 ^		3.027	1.921	0,31
3,699 % fällig am 25.12.2035		332	252	0,04
5,550 % fällig am 25.10.2036		3.233	2.790	0,45
JPMorgan Alternative Loan Trust				
5,470 % fällig am 25.11.2036 ^		4.291	3.580	0,58
JPMorgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust				
5,350 % fällig am 05.07.2033		1.950	1.648	0,27
6,241 % fällig am 12.02.2051		60	494	0,08
JPMorgan Resecuritization Trust				
4,500 % fällig am 26.04.2037		939	459	0,07
5,428 % fällig am 26.09.2037		1.301	976	0,16
Lehman Mortgage Trust				
6,000 % fällig am 25.12.2036		1.451	1.212	0,20
Lehman XS Trust				
5,630 % fällig am 25.06.2047		5.684	5.120	0,83
MASTR Asset Securitization Trust				
6,000 % fällig am 25.10.2036		661	581	0,09
MASTR Reperforming Loan Trust				
7,000 % fällig am 25.07.2035		1.221	867	0,14
Merrill Lynch Mortgage Investors Trust				
6,250 % fällig am 25.08.2036		4.086	1.828	0,29
Morgan Stanley Mortgage Loan Trust				
5,500 % fällig am 25.11.2035		1.054	722	0,12
6,000 % fällig am 25.10.2037		6.311	3.424	0,55
Mortgage Equity Conversion Asset Trust				
5,720 % fällig am 25.02.2042		733	708	0,11
Nomura Asset Acceptance Corp. Alternative Loan Trust				
3,834 % fällig am 25.10.2035		936	542	0,09
6,017 % fällig am 25.06.2037		1.266	1.071	0,17
Nomura Resecuritization Trust				
3,654 % fällig am 26.11.2036		1.999	1.762	0,28
Residential Accredit Loans, Inc. Trust				
5,169 % fällig am 25.12.2035		1.198	577	0,09
5,450 % fällig am 25.08.2036		857	627	0,10
6,000 % fällig am 25.01.2037 ^		167	129	0,02
6,250 % fällig am 25.01.2037 ^		966	784	0,13
Residential Asset Securitization Trust				
6,000 % fällig am 25.12.2036 ^		2.987	949	0,15
RMAC Securities PLC				
5,154 % fällig am 12.06.2044	£	377	459	0,07
Sestante Finance SRL				
3,431 % fällig am 23.07.2046	€	886	915	0,15
Stratton BTL Mortgage Funding PLC				
6,141 % fällig am 20.01.2054	£	3.000	3.408	0,55
Stratton Mortgage Funding PLC				
6,491 % fällig am 20.07.2060		2.200	2.790	0,45
6,642 % fällig am 25.09.2051		5.000	6.294	1,01
6,991 % fällig am 20.07.2060		2.500	3.134	0,51
7,491 % fällig am 20.07.2060		3.600	4.521	0,73
7,865 % fällig am 12.03.2052		1.400	1.738	0,28
Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust				
4,238 % fällig am 25.07.2035	$	1.573	791	0,13
4,706 % fällig am 25.05.2035		988	780	0,13
5,282 % fällig am 25.02.2034		7	7	0,00
5,450 % fällig am 25.02.2037		474	455	0,07
5,590 % fällig am 25.06.2037		319	283	0,05
5,649 % fällig am 25.12.2034		1.672	1.539	0,25
Structured Asset Mortgage Investments Trust				
5,370 % fällig am 25.09.2047		3.203	2.672	0,43
5,690 % fällig am 25.08.2035		482	431	0,07
6,271 % fällig am 19.12.2033		379	356	0,06
Structured Asset Securities Corp.				
5,400 % fällig am 25.07.2035		1.368	1.241	0,20
Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust				
5,400 % fällig am 25.05.2036	$	2.006	$ 1.617	0,26
Trinity Square PLC				
6,166 % fällig am 15.07.2059	£	3.200	4.033	0,65
6,466 % fällig am 15.07.2059		2.400	2.997	0,48
7,216 % fällig am 15.07.2059		1.600	1.996	0,32
Tudor Rose Mortgages				
6,059 % fällig am 20.06.2048		5.105	6.333	1,02
6,409 % fällig am 20.06.2048		9.746	11.946	1,93
Twin Bridges PLC				
6,565 % fällig am 01.12.2055		3.007	3.554	0,57
Uropa Securities PLC				
4,779 % fällig am 10.10.2040		64	78	0,01
4,879 % fällig am 10.10.2040		32	39	0,01
Verus Securitization Trust				
2,338 % fällig am 25.10.2063	$	1.250	989	0,16
3,195 % fällig am 25.10.2063		1.000	765	0,12
4,199 % fällig am 25.10.2063		1.000	728	0,12
WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust				
3,528 % fällig am 25.12.2036 ^		2.231	1.963	0,32
3,784 % fällig am 25.06.2037 ^		3.137	2.757	0,44
4,746 % fällig am 25.04.2047 ^		62	52	0,01
4,936 % fällig am 25.09.2046		928	766	0,12
5,226 % fällig am 25.01.2047		661	595	0,10
5,476 % fällig am 25.11.2046		297	262	0,04
Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates Trust				
4,966 % fällig am 25.06.2046		2.027	1.609	0,26
Worldwide Plaza Trust				
3,715 % fällig am 10.11.2036		3.950	2.534	0,41
			200.447	32,31

FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE

BESCHREIBUNG		PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
Accredited Mortgage Loan Trust				
6,170 % fällig am 25.07.2035		2.150	1.990	0,32
ACE Securities Corp. Home Equity Loan Trust				
6,125 % fällig am 25.11.2033		676	648	0,11
Aegis Asset-Backed Securities Trust				
6,150 % fällig am 25.03.2035 ^		53	49	0,01
Aegis Asset-Backed Securities Trust Mortgage Pass-Through Certificates				
6,980 % fällig am 25.12.2034		1.073	906	0,15
Ameriquest Mortgage Securities Trust				
5,720 % fällig am 25.04.2036		6.350	5.339	0,86
Ameriquest Mortgage Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates				
6,245 % fällig am 25.09.2034		3.079	2.748	0,44
Argent Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates				
5,630 % fällig am 25.05.2035		2.434	2.194	0,35
Asset-Backed Securities Corp. Home Equity Loan Trust				
3,240 % fällig am 25.03.2036		1.593	1.351	0,22
6,380 % fällig am 25.02.2035		946	921	0,15
Attentus CDO Ltd.				
5,661 % fällig am 11.10.2042		10.034	8.654	1,40
Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust				
4,993 % fällig am 25.12.2035		1.678	1.445	0,23
5,085 % fällig am 25.04.2036		1.638	1.628	0,26
5,630 % fällig am 25.07.2036		388	385	0,06
6,200 % fällig am 25.08.2037		8.165	6.853	1,11
6,350 % fällig am 25.01.2045		39	39	0,01
7,025 % fällig am 25.07.2034		161	128	0,02
Capitalsource Real Estate Loan Trust				
5,861 % fällig am 20.01.2037		532	490	0,08
5,961 % fällig am 20.01.2037		350	293	0,05
6,061 % fällig am 20.01.2037		200	164	0,03
Cardiff Auto Receivables Securitisation PLC				
6,754 % fällig am 21.10.2028	£	3.200	4.055	0,65
7,704 % fällig am 21.10.2028		8.775	10.923	1,76
Castlelake Aircraft Securitization Trust				
4,125 % fällig am 15.06.2043	$	1.878	1.697	0,27
Citigroup Mortgage Loan Trust				
5,470 % fällig am 25.12.2036		3.320	1.866	0,30
Conseco Finance Corp.				
6,920 % fällig am 01.12.2030		2.029	2.028	0,33
Countrywide Asset-Backed Certificates Trust				
5,300 % fällig am 25.04.2047 ^		5	5	0,00

BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
5,370 % fällig am 25.09.2037 ^	$ 2.096	$ 2.103	0,34
5,370 % fällig am 25.09.2047 ^	932	891	0,14
5,633 % fällig am 25.06.2035	92	78	0,01
5,850 % fällig am 25.03.2036 ^	1.871	1.615	0,26
5,859 % fällig am 25.10.2046 ^	12	12	0,00
6,125 % fällig am 25.01.2036	67	65	0,01
Countrywide Asset-Backed Certificates Trust, Inc.			
6,125 % fällig am 25.10.2034	75	73	0,01
Credit-Based Asset Servicing & Securitization LLC			
2,817 % fällig am 25.05.2036	2.105	1.384	0,22
3,289 % fällig am 25.03.2034	276	276	0,05
Credit-Based Asset Servicing & Securitization Mortgage Loan Trust			
3,535 % fällig am 25.02.2037	2.974	1.822	0,29
First Franklin Mortgage Loan Trust			
5,810 % fällig am 25.01.2036	399	392	0,06
Fremont Home Loan Trust			
5,430 % fällig am 25.02.2037	5.972	4.602	0,74
5,630 % fällig am 25.08.2036	4.084	1.370	0,22
6,080 % fällig am 25.07.2035	4.000	3.082	0,50
Goodgreen Trust			
3,930 % fällig am 15.10.2053	1.977	1.761	0,28
GSAA Home Equity Trust			
5,610 % fällig am 25.04.2047	3.767	1.849	0,30
5,870 % fällig am 25.10.2035	1.950	1.702	0,27
GSAMP Trust			
5,420 % fällig am 25.03.2047	694	641	0,10
Harley Marine Financing LLC			
6,682 % fällig am 15.05.2043	1.263	1.176	0,19
Harvest CLO DAC			
1,040 % fällig am 15.07.2031 €	800	796	0,13
Home Equity Asset Trust			
3,883 % fällig am 25.02.2036 $	949	912	0,15
5,470 % fällig am 25.08.2036	695	690	0,11
5,630 % fällig am 25.08.2037	564	556	0,09
6,440 % fällig am 25.08.2033	306	290	0,05
Home Equity Mortgage Loan Asset-Backed Trust			
5,390 % fällig am 25.04.2037	6.643	4.336	0,70
JPMorgan Mortgage Acquisition Trust			
3,967 % fällig am 25.11.2036	194	167	0,03
5,270 % fällig am 25.12.2036	5.952	3.139	0,51
Jubilee CLO DAC			
3,827 % fällig am 15.04.2031 €	400	426	0,07
Laurelin DAC			
1,800 % fällig am 20.10.2031	3.500	3.292	0,53
Lehman XS Trust			
5,570 % fällig am 25.06.2046 $	3.169	2.899	0,47

BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
Long Beach Mortgage Loan Trust			
5,750 % fällig am 25.02.2036 $	142	$ 117	0,02
6,170 % fällig am 25.08.2033	112	112	0,02
Man GLG Euro CLO DAC			
1,680 % fällig am 15.12.2031 €	4.700	4.444	0,72
1,700 % fällig am 15.10.2030	5.000	4.829	0,78
MAPS Ltd.			
4,212 % fällig am 15.05.2043 $	1.938	1.731	0,28
MASTR Asset-Backed Securities Trust			
5,730 % fällig am 25.12.2035	160	159	0,03
Merrill Lynch Mortgage Investors Trust			
6,230 % fällig am 25.10.2035	686	674	0,11
Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust			
3,580 % fällig am 25.01.2035	792	685	0,11
5,290 % fällig am 25.10.2036	1.017	443	0,07
5,400 % fällig am 25.07.2036	9.734	8.390	1,35
5,450 % fällig am 25.07.2036	3.443	1.320	0,21
5,650 % fällig am 25.07.2036	3.443	1.330	0,21
5,720 % fällig am 25.12.2035	0	0	0,00
5,750 % fällig am 25.12.2035	0	0	0,00
Morgan Stanley Capital, Inc. Trust			
5,730 % fällig am 25.01.2036	1.854	1.774	0,29
Morgan Stanley Home Equity Loan Trust			
5,250 % fällig am 25.04.2037	141	74	0,01
Morgan Stanley IXIS Real Estate Capital Trust			
5,450 % fällig am 25.07.2036	3.566	1.453	0,23
National Collegiate Student Loan Trust			
5,460 % fällig am 25.05.2032	2.236	2.124	0,34
Option One Mortgage Loan Trust			
5,290 % fällig am 25.03.2037	4.936	4.432	0,72
Park Place Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates			
6,725 % fällig am 25.02.2035	335	324	0,05
6,800 % fällig am 25.12.2034	238	245	0,04
Popular ABS Mortgage Pass-Through Trust			
5,645 % fällig am 25.07.2036	2.407	2.252	0,36
5,690 % fällig am 25.05.2036 ^	379	350	0,06
Renaissance Home Equity Loan Trust			
5,608 % fällig am 25.05.2036	5.982	2.898	0,47
5,746 % fällig am 25.05.2036	1.362	675	0,11
Residential Asset Mortgage Products Trust			
5,690 % fällig am 25.02.2036	200	188	0,03
Residential Asset Securities Corp. Trust			
4,906 % fällig am 25.06.2034	703	680	0,11
5,585 % fällig am 25.06.2036	1.400	1.335	0,22
6,095 % fällig am 25.05.2035	38	37	0,01
6,185 % fällig am 25.08.2035	2.131	2.010	0,32

BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
Sapphire Aviation Finance Ltd.			
4,250 % fällig am 15.03.2040 $	5.392	$ 4.493	0,72
Securitized Asset-Backed Receivables LLC Trust			
5,270 % fällig am 25.09.2036	2.201	1.499	0,24
SoFi Professional Loan Program LLC			
2,650 % fällig am 25.09.2040	43	41	0,01
Soundview Home Loan Trust			
5,320 % fällig am 25.07.2037	5.834	4.792	0,77
6,050 % fällig am 25.10.2037	6.827	5.388	0,87
6,140 % fällig am 25.06.2035	683	646	0,10
6,450 % fällig am 25.10.2037	5.465	4.049	0,65
Structured Asset Investment Loan Trust			
5,750 % fällig am 25.04.2036	11.187	6.020	0,97
Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust			
5,280 % fällig am 25.05.2036	312	300	0,05
6,275 % fällig am 25.04.2035	88	87	0,01
Taberna Preferred Funding Ltd.			
5,666 % fällig am 05.05.2038	3.739	3.515	0,57
5,693 % fällig am 05.07.2035	233	207	0,03
Terwin Mortgage Trust			
6,095 % fällig am 25.06.2036	200	193	0,03
Thunderbolt Aircraft Lease Ltd.			
4,147 % fällig am 15.09.2038	6.836	5.849	0,94
TruPS Financials Note Securitization Ltd.			
7,080 % fällig am 20.09.2039	2.363	2.257	0,36
Wells Fargo Home Equity Asset-Backed Securities Trust			
5,570 % fällig am 25.03.2037	1.146	1.118	0,18
		184.735	29,78
KURZFRISTIGE INSTRUMENTE			
U.S. TREASURY BILLS			
5,207 % fällig am 10.08.2023 (d)(e)	4.800	4.774	0,77
Summe kurzfristige Instrumente		4.774	0,77
Summe Übertragbare Wertpapiere		**$ 1.421.861**	**229,21**
	AKTIEN		
INVESTMENTFONDS			
ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN			
PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (g)	2.399	24	0,00
Summe Investmentfonds		**$ 24**	**0,00**

PENSIONSGESCHÄFTE

Kontrahent	Kredit-zins	Abrechnungs-datum	Fälligkeits-datum	Kapital-betrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensions-geschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensions-geschäft[1]	% des Nettovermögens
FICC	2,400 %	30.06.2023	03.07.2023	$ 241	U.S. Treasury Notes 4,625 % fällig am 30.06.2025	$ (246)	$ 241	$ 241	0,04
	2,400	30.06.2023	03.07.2023	3.767	U.S. Treasury Notes 4,625 % fällig am 30.06.2025	(3.842)	3.767	3.767	0,61
Summe Pensionsgeschäfte						**$ (4.088)**	**$ 4.008**	**$ 4.008**	**0,65**

[1] Umfasst aufgelaufene Zinsen.

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

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

FUTURES

Beschreibung	Art	Ablauf-monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
3-Month SOFR December Futures	Long	03.2024	62	$ (40)	(0,01)
3-Month SOFR June Futures	Short	09.2024	89	62	0,01
3-Month SOFR March Futures	Long	06.2024	54	(12)	0,00
3-Month SOFR September Futures	Short	12.2023	27	9	0,00
30-Day Federal Fund February Futures	Short	02.2024	45	133	0,02
30-Day Federal Fund November Futures	Long	11.2023	45	(90)	(0,02)
U.S. Treasury 2-Year Note September Futures	Short	09.2023	155	283	0,05
U.S. Treasury 5-Year Note September Futures	Short	09.2023	27	56	0,01

Beschreibung	Art	Ablauf-monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
U.S. Treasury 10-Year Note September Futures	Long	09.2023	135	$ (256)	(0,04)
U.S. Treasury 10-Year Note September Futures	Short	09.2023	174	363	0,06
U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond September Futures	Short	09.2023	27	(53)	(0,01)
				$ 455	0,07

VERKAUFSOPTIONEN

OPTIONEN AUF BÖRSENGEHANDELTE TERMINKONTRAKTE

Beschreibung	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Anzahl der Kontrakte	Aufgeld	Markt-wert	% des Nettovermögens
Put - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note August Futures	$ 111,500	21.07.2023	159	$ (69)	$ (60)	(0,01)
Call - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note August Futures	115,500	21.07.2023	159	(56)	(8)	0,00
				$ (125)	$ (68)	(0,01)
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate					**$ 387**	**0,06**

ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)

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

ZINSSWAPS

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fest-Zinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Erhalt[1]	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	3,250 %	20.09.2053	£ 400	$ 36	0,01
Zahlung[1]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,827	03.07.2028	$ 85.485	(7.951)	(1,28)
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,998	09.03.2025	31.400	1.572	0,25
Erhalt[1]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,999	03.07.2053	17.445	3.883	0,63
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,034	02.03.2025	57.500	2.902	0,47
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,000	21.06.2030	35.300	1.188	0,19
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,000	21.06.2033	3.100	(119)	(0,02)
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,250	21.06.2028	35.100	703	0,11
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,260	08.06.2033	3.300	50	0,01
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,500	21.06.2026	8.600	218	0,03
Erhalt[1]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,500	20.12.2030	10.300	26	0,00
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,505	08.03.2033	900	(2)	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,510	08.03.2033	2.500	5	0,00
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,513	08.03.2030	12.000	116	0,02
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,635	08.03.2030	5.400	10	0,00
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	4,500	21.06.2024	300.400	1.412	0,23
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	0,250	18.03.2050	€ 2.400	1.045	0,17
Erhalt[1]	6-Month EUR-EURIBOR	3,000	20.09.2033	13.100	(116)	(0,02)
					$ 4.978	0,80
Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate					**$ 4.978**	**0,80**

[1] Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft.

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

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

OPTIONSKAUF

ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag[1]	Kosten	Markt-wert	% des Nettovermögens
BOA	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	5,500 %	18.09.2023	88.600	$ 198	$ 108	0,02
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	1,010	23.01.2024	1.200	1	0	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	1,500	24.01.2024	1.000	3	0	0,00
BPS	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,500	05.02.2024	76.000	509	1.732	0,28
	Call - OTC 7-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,800	20.12.2023	5.300	107	30	0,00
	Put - OTC 7-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,550	20.12.2023	15.800	319	300	0,05
BRC	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	5,500	27.12.2024	28.400	119	120	0,02
	Call - OTC 7-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,800	20.12.2023	5.200	107	29	0,00
	Put - OTC 7-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,550	20.12.2023	15.800	319	300	0,05
CBK	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,400	19.05.2027	13.900	79	105	0,02
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,500	09.02.2024	24.700	179	568	0,09
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,500	20.02.2024	61.000	530	1.419	0,23
DUB	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	4,100	01.02.2024	30.000	68	255	0,04
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	5,500	16.12.2024	39.000	46	57	0,01
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,875	03.01.2024	1.400	38	12	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,625	03.01.2024	1.400	38	24	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,040	11.01.2024	11.100	106	15	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	4,040	11.01.2024	11.100	106	94	0,02
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	1,995	16.01.2024	10.400	101	13	0,00

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag[1]	Kosten	Markt-wert	% des Nettovermögens
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,995 %	16.01.2024	10.400	$ 101	$ 97	0,02
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	1,016	23.01.2024	2.000	3	0	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,500	07.02.2024	77.500	554	1.776	0,29
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	1,953	21.02.2024	2.300	7	4	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,500	28.02.2024	35.500	288	837	0,13
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,500	04.03.2024	35.500	259	841	0,14
GLM	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	5,500	18.09.2023	85.600	188	105	0,02
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,400	19.05.2027	20.000	107	151	0,02
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	4,000	26.10.2023	2.200	66	13	0,00
	Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,790	03.05.2024	14.800	322	126	0,02
	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,790	03.05.2024	14.800	322	579	0,09
	Call - OTC 7-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,655	12.12.2023	21.200	462	83	0,01
	Put - OTC 7-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,405	12.12.2023	21.200	462	495	0,08
JPM	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	5,500	16.12.2024	14.600	61	60	0,01
MYC	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	5,000	14.06.2024	33.500	52	89	0,01
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	5,000	16.12.2024	16.800	28	39	0,01
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,433	27.02.2024	2.300	17	11	0,00
	Call - OTC 7-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,285	04.03.2024	8.500	160	156	0,03
	Put - OTC 7-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,985	04.03.2024	8.500	160	93	0,02
							$ 6.592	$ 10.736	1,73

OPTIONEN AUF WERTPAPIERE

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag[1]	Kosten	Markt-wert	% des Nettovermögens
JPM	Call - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.07.2053	$ 116,000	06.07.2023	200.000	$ 8	$ 0	0,00
	Call - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,000 % fällig am 01.08.2053	115,000	07.08.2023	15.000	1	0	0,00
	Call - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 2,500 % fällig am 01.08.2053	116,000	07.08.2023	20.000	1	0	0,00
	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 3,000 % fällig am 01.09.2053	70,000	07.09.2023	10.700	0	0	0,00
	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 4,000 % fällig am 01.08.2053	72,000	07.08.2023	35.000	1	0	0,00
	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 4,000 % fällig am 01.09.2053	72,000	07.09.2023	5.000	0	0	0,00
	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 4,500 % fällig am 01.07.2053	72,000	06.07.2023	100.000	4	0	0,00
	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 4,500 % fällig am 01.08.2053	72,000	07.08.2023	90.000	2	0	0,00
	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 5,000 % fällig am 01.08.2053	74,000	07.08.2023	13.000	1	0	0,00
	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 5,500 % fällig am 01.07.2053	76,000	06.07.2023	75.000	3	0	0,00
	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 5,500 % fällig am 01.08.2053	75,000	07.08.2023	24.000	1	0	0,00
	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 5,500 % fällig am 01.08.2053	77,000	07.08.2023	30.000	1	0	0,00
	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 6,000 % fällig am 01.09.2053	76,000	07.09.2023	5.000	0	0	0,00
	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 6,500 % fällig am 01.08.2053	77,000	07.08.2023	15.000	1	0	0,00
SAL	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 5,500 % fällig am 01.07.2053	98,766	06.07.2023	3.000	4	0	0,00
	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 5,500 % fällig am 01.09.2053	97,898	07.09.2023	12.500	39	45	0,01
					$ 67	$ 45	0,01

VERKAUFSOPTIONEN

ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag[1]	Aufgeld	Markt-wert	% des Nettovermögens
BOA	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	5,750 %	18.09.2023	44.300	$ (78)	$ (24)	(0,01)
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	6,000	18.09.2023	44.300	(66)	(8)	0,00
	Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,070	10.07.2023	5.600	(37)	(14)	0,00
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,370	10.07.2023	5.600	(37)	(4)	0,00
CBK	Put - OTC 7-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,740	06.07.2023	1.500	(5)	(3)	0,00
DUB	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,600	01.02.2024	30.000	(33)	(157)	(0,03)
GLM	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	5,750	18.09.2023	42.800	(75)	(23)	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	6,000	18.09.2023	42.800	(62)	(8)	0,00
	Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,043	03.08.2023	14.800	(185)	(5)	0,00
	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,043	03.08.2023	14.800	(185)	(544)	(0,09)
	Put - OTC 7-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,045	07.09.2023	9.800	(39)	(39)	(0,01)
							$ (802)	$ (829)	(0,14)

OPTIONEN AUF WERTPAPIERE

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag[1]	Aufgeld	Markt-wert	% des Nettovermögens
BOA	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 4,000 % fällig am 01.07.2053	$ 93,984	06.07.2023	4.000	$ (10)	$ (14)	0,00
JPM	Call - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 4,000 % fällig am 01.07.2053	95,281	06.07.2023	6.000	(22)	(1)	0,00
	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 4,000 % fällig am 01.08.2053	94,172	07.08.2023	15.000	(173)	(139)	(0,02)
MSC	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 4,000 % fällig am 01.07.2053	93,281	06.07.2023	5.000	(20)	(5)	0,00
SAL	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 4,000 % fällig am 01.07.2053	93,859	06.07.2023	3.500	(7)	(10)	0,00
	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 4,000 % fällig am 01.07.2053	94,000	06.07.2023	3.500	(7)	(13)	0,00
	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 4,500 % fällig am 01.08.2053	95,672	07.08.2023	10.000	(60)	(51)	(0,01)
	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 4,500 % fällig am 01.08.2053	95,875	07.08.2023	2.000	(12)	(12)	0,00
	Call - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 4,500 % fällig am 01.08.2053	97,672	07.08.2023	10.000	(55)	(18)	(0,01)
	Call - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 4,500 % fällig am 01.08.2053	97,875	07.08.2023	2.000	(11)	(3)	0,00
					$ (377)	$ (266)	(0,04)

[1] Der Nennbetrag stellt die Anzahl der Kontrakte dar.

DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BRC	07.2023	£ 498	$ 618	$ 0	$ (15)	$ (15)	0,00
CBK	07.2023	€ 16.338	17.532	0	(293)	(293)	(0,05)
	07.2023	$ 496	£ 388	0	(2)	(2)	0,00
MBC	07.2023	€ 211	$ 226	0	(5)	(5)	0,00
MYI	07.2023	95	103	0	0	0	0,00
	07.2023	$ 24	£ 19	0	0	0	0,00
UAG	07.2023	£ 64.660	$ 80.576	0	(1.630)	(1.630)	(0,26)
				$ 0	$ (1.945)	$ (1.945)	(0,31)

ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklasse Institutional CAD (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2023	$ 5.840	CAD 7.946	$ 165	$ 0	$ 165	0,03
BPS	07.2023	CAD 174	$ 131	0	0	0	0,00
CBK	07.2023	$ 5.829	CAD 7.943	174	0	174	0,03
GLM	07.2023	34	46	1	0	1	0,00
MBC	07.2023	133	178	2	0	2	0,00
SCX	07.2023	5.856	7.953	154	0	154	0,02
				$ 496	$ 0	$ 496	0,08

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklassen Institutional CHF (Hedged) thesaurierend und Class E CHF (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BPS	07.2023	CHF 896	$ 1.002	$ 0	$ 0	$ 0	0,00
	07.2023	$ 1.217	CHF 1.101	13	0	13	0,00
	08.2023	1.002	893	0	0	0	0,00
CLY	07.2023	CHF 473	$ 527	0	(2)	(2)	0,00
	08.2023	$ 527	CHF 472	2	0	2	0,00
MBC	07.2023	CHF 18	$ 20	0	0	0	0,00
	07.2023	$ 273	CHF 245	1	0	1	0,00
MYI	07.2023	CHF 11	$ 12	0	0	0	0,00
	07.2023	$ 51	CHF 45	0	0	0	0,00
RYL	07.2023	CHF 40	$ 45	0	0	0	0,00
SCX	07.2023	$ 912	CHF 820	4	0	4	0,00
UAG	07.2023	CHF 980	$ 1.094	0	(2)	(2)	0,00
	07.2023	$ 822	CHF 739	4	0	4	0,00
	08.2023	1.025	917	2	0	2	0,00
				$ 26	$ (4)	$ 22	0,00

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklassen Institutional EUR (Hedged) thesaurierend, Institutional EUR (Hedged) ausschüttend und Class E EUR (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2023	$ 51.657	€ 48.065	$ 783	$ 0	$ 783	0,12
BPS	07.2023	€ 48.723	$ 53.383	226	0	226	0,04
	07.2023	$ 52.395	€ 48.719	766	(8)	758	0,12
	08.2023	52.756	48.080	0	(229)	(229)	(0,04)
CBK	07.2023	€ 48.312	$ 52.526	0	(184)	(184)	(0,03)
	07.2023	$ 1.446	€ 1.324	3	(4)	(1)	0,00
	08.2023	52.348	48.081	181	0	181	0,03
JPM	07.2023	€ 48.081	$ 52.500	43	0	43	0,01
	07.2023	$ 51.241	€ 47.926	1.047	0	1.047	0,17
	08.2023	52.573	48.081	0	(45)	(45)	(0,01)
MBC	07.2023	€ 932	$ 998	0	(19)	(19)	0,00
	07.2023	$ 705	€ 643	0	(3)	(3)	0,00
				$ 3.049	$ (492)	$ 2.557	0,41

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklassen Institutional GBP (Hedged) thesaurierend und Institutional GBP (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2023	£ 196	$ 248	$ 0	$ (1)	$ (1)	0,00
	07.2023	$ 13	£ 10	0	0	0	0,00
BPS	07.2023	£ 14	$ 17	0	0	0	0,00
	07.2023	$ 4.634	£ 3.746	129	0	129	0,02
BRC	07.2023	£ 575	$ 713	0	(17)	(17)	0,00
	07.2023	$ 6	£ 5	0	0	0	0,00
CBK	07.2023	£ 404	$ 511	0	(3)	(3)	0,00

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung		Zu erhaltende Währung		Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
	07.2023	$	19	£	15	$ 0	$ 0	$ 0	0,00
JPM	07.2023	£	3.578	$	4.524	0	(25)	(25)	0,00
	08.2023	$	4.525	£	3.578	25	0	25	0,00
MBC	07.2023		4.654		3.759	125	0	125	0,02
MYI	07.2023		4.627		3.723	106	0	106	0,02
SCX	07.2023		892		717	20	0	20	0,00
TOR	07.2023	£	3.599	$	4.574	0	(2)	(2)	0,00
	08.2023	$	4.575	£	3.599	2	0	2	0,00
						$ 407	$ (48)	$ 359	0,06
Summe Freiverkehrsfinanzderivate								**$ 11.175**	**1,80**

LEERVERKAUFTE WERTPAPIERE

BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
US-REGIERUNGSBEHÖRDEN			
Ginnie Mae, TBA			
2,000 % fällig am 01.08.2053	$ 7.900	$ (6.646)	(1,07)
2,500 % fällig am 01.08.2053	26.200	(22.708)	(3,66)
4,000 % fällig am 01.08.2053	4.800	(4.546)	(0,73)
Uniform Mortgage-Backed Security, TBA			
2,000 % fällig am 01.07.2038	29.800	(26.410)	(4,26)
2,000 % fällig am 01.07.2053	65.954	(53.802)	(8,67)
2,000 % fällig am 01.08.2053	149.796	(122.370)	(19,73)
2,500 % fällig am 01.07.2053	7.100	(6.022)	(0,97)
3,000 % fällig am 01.07.2038	500	(466)	(0,07)
3,000 % fällig am 01.08.2053	57.750	(50.908)	(8,21)
4,000 % fällig am 01.07.2038	3.700	(3.572)	(0,58)
4,000 % fällig am 01.08.2053	57.000	(53.542)	(8,63)
4,500 % fällig am 01.08.2053	16.050	(15.439)	(2,49)
5,000 % fällig am 01.08.2053	24.200	(23.718)	(3,82)
Summe Leerverkaufte Wertpapiere		**$ (390.149)**	**(62,89)**
Summe Anlagen		**$ 1.052.284**	**169,63**
Sonstige Aktiva und Passiva		**$ (431.948)**	**(69,63)**
Nettovermögen		**$ 620.336**	**100,00**

ERLÄUTERUNGEN ZUR AUFSTELLUNG DES WERTPAPIERBESTANDS (Angaben in Tausend*):

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

^ Das Wertpapier ist in Verzug.

(a) Bei dem Wertpapier handelt es sich um ein Interest Only- („IO“) bzw. IO-Strip.

(b) Reines Kapitalwertpapier.

(c) Wertpapier per Emissionstermin.

(d) Nullkuponwertpapier.

(e) Der Kupon stellt eine Rendite bis zur Endfälligkeit dar.

(f) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

(g) Mit dem Fonds verbunden.

(h) Wertpapiere mit einem gesamten beizulegenden Zeitwert von 354.567 USD (31. Dezember 2022: 324.164 USD) und Barmittel in Höhe von 569 USD (31. Dezember 2022: null USD) wurde zum 30. Juni 2023 gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte als Sicherheit verpfändet.

Barmittel in Höhe von null USD (31. Dezember 2022: 4.656 USD) wurden zum 30. Juni 2023 gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte als Sicherheit geliefert.

Barmittel in Höhe von 8.177 USD (31. Dezember 2022: 4.327 USD) wurden zum 30. Juni 2023 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Barmittel in Höhe von 1.230 USD (31. Dezember 2022: 4.020 USD) wurden zum 30. Juni 2023 gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. als Sicherheit für Finanzderivate verpfändet.

Beizulegender Zeitwert[1]

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 30. Juni 2023 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie[2]	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	$ 0	$ 1.417.010	$ 4.851	$ 1.421.861
Investmentfonds	24	0	0	24
Pensionsgeschäfte	0	4.008	0	4.008
Finanzderivate[3]	0	16.540	0	16.540
Leerverkaufte Wertpapiere	0	(390.149)	0	(390.149)
Summen	**$ 24**	**$ 1.047.409**	**$ 4.851**	**$ 1.052.284**

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

Kategorie[2]	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	$ 0	$ 1.723.820	$ 1.179	$ 1.724.999
Investmentfonds	23	0	0	23
Pensionsgeschäfte	0	17.318	0	17.318
Finanzderivate[3]	0	26.778	0	26.778
Leerverkaufte Wertpapiere	0	(518.212)	0	(518.212)
Summen	**$ 23**	**$ 1.249.704**	**$ 1.179**	**$ 1.250.906**

(1) Weitere Informationen finden Sie in den Erläuterungen in Erläuterung 3.

(2) Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung des Wertpapierbestands.

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

Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2023:

Kontrahent	Kredit-zins	Abrechnungs-datum	Fälligkeits-datum	Kredit-betrag	Verbindlichkeiten aus umgekehrten Pensions-geschäften	% des Nettovermögens
BOS	5,180 %	20.06.2023	13.07.2023	$ (6.759)	$ (6.770)	(1,09)
CIB	5,180	15.06.2023	13.07.2023	(337.645)	(338.422)	(54,56)
Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte					**$ (345.192)**	**(55,65)**

Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC-Finanzderivate und -Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2023 und 31. Dezember 2022:

	Zum 30. Jun. 2023			Zum 31. Dez. 2022		
Kontrahent	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-engagement[1]	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-engagement[1]
BOA	$ 991	$ (790)	$ 201	$ (3.187)	$ 2.810	$ (377)
BPS	2.959	(2.920)	39	3.438	(3.310)	128
BRC	417	(390)	27	500	(480)	20
CBK	1.961	(2.090)	(129)	11.235	(10.950)	285
CLY	k. A.	k. A.	k. A.	11	0	11
DUB	3.868	(4.050)	(182)	6.229	(5.990)	239
GLM	934	(910)	24	1.201	(1.080)	121
JPM	965	50	1.015	(743)	730	(13)
MBC	101	0	101	2.699	(2.490)	209
MSC	(5)	0	(5)	(94)	0	(94)
MYC	388	(300)	88	2.285	(2.410)	(125)
MYI	106	(20)	86	(6)	0	(6)
SAL	(62)	0	(62)	(418)	480	62
SCX	178	0	178	1.971	(1.850)	121
TOR	k. A.	k. A.	k. A.	4	0	4
UAG	(1.626)	1.180	(446)	k. A.	k. A.	k. A.

(1) Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären.

Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung des Wertpapierbestands zum 30. Juni 2023:

	30. Jun. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	42,02	25,41
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	187,19	174,84
Sonstige übertragbare Wertpapiere	k. A.	2,90
Investmentfonds	0,00	0,00
Pensionsgeschäfte	0,65	2,04
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	0,06	0,54
Zentral abgerechnete Finanzderivate	0,80	(0,35)
Freiverkehrsfinanzderivate	1,80	2,96
Leerverkaufte Wertpapiere	(62,89)	(61,03)
Umgekehrte Pensionsgeschäfte	(55,65)	(37,27)

Das Anlageportfolio des Fonds konzentriert sich zum 30. Juni 2023 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	30. Jun. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
Unternehmensanleihen und Wechsel	0,12	0,10
US-Regierungsbehörden	165,12	121,51
US-Schatzobligationen	1,11	0,51
Non-Agency-MBS	32,31	37,20
Forderungsbesicherte Wertpapiere	29,78	35,71
Kurzfristige Instrumente	0,77	8,12
Investmentfonds	0,00	0,00
Pensionsgeschäfte	0,65	2,04
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	0,07	0,54
Verkaufsoptionen		
Optionen auf börsengehandelte Terminkontrakte	(0,01)	k. A.
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Zinsswaps	0,80	(0,35)
Freiverkehrsfinanzderivate		
Optionskauf		
Zinsswapoptionen	1,73	3,42
Optionen auf Wertpapiere	0,01	0,00
Verkaufsoptionen		
Zinsswapoptionen	(0,14)	(1,08)
Optionen auf Wertpapiere	(0,04)	(0,20)
Devisenterminkontrakte	(0,31)	0,14
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	0,55	0,68
Leerverkaufte Wertpapiere	(62,89)	(61,03)
Sonstige Aktiva und Passiva	(69,63)	(47,31)
Nettovermögen	100,00	100,00

Aufstellung des Wertpapierbestands des StocksPLUS™ Fund

BESCHREIBUNG		PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
BANKEN UND FINANZEN				
AerCap Ireland Capital DAC				
2,875 % fällig am 14.08.2024	$	1.700	$ 1.634	0,09
American Honda Finance Corp.				
5,000 % fällig am 23.05.2025		4.100	4.085	0,23
American Tower Corp.				
1,450 % fällig am 15.09.2026		8.200	7.222	0,40
3,800 % fällig am 15.08.2029		1.305	1.192	0,07
Australia & New Zealand Banking Group Ltd.				
4,675 % fällig am 15.06.2026		5.000	4.945	0,27
Bank of Nova Scotia				
3,050 % fällig am 31.10.2024	€	5.000	5.391	0,30
Barclays PLC				
5,829 % fällig am 09.05.2027	$	3.900	3.849	0,21
Credit Agricole Home Loan SFH S.A.				
0,125 % fällig am 16.12.2024	€	1.100	1.137	0,06
Deutsche Bank AG				
1,375 % fällig am 17.02.2032		10.000	8.095	0,45
GA Global Funding Trust				
6,380 % fällig am 11.04.2025	$	6.800	6.666	0,37
Nykredit Realkredit A/S				
5,000 % fällig am 01.10.2053	DKK	42.698	6.162	0,34
Sumitomo Mitsui Banking Corp.				
3,602 % fällig am 16.02.2026	€	5.000	5.387	0,30
Toronto-Dominion Bank				
0,500 % fällig am 03.04.2024		3.000	3.194	0,18
4,701 % fällig am 05.06.2027	$	9.000	8.905	0,49
UniCredit SpA				
3,375 % fällig am 31.01.2027	€	6.200	6.675	0,37
Van Lanschot Kempen NV				
3,500 % fällig am 31.05.2026		300	325	0,02
			74.864	4,15
INDUSTRIEWERTE				
DAE Funding LLC				
3,375 % fällig am 20.03.2028	$	2.800	2.527	0,14
Imperial Brands Finance PLC				
3,125 % fällig am 26.07.2024		200	193	0,01
3,500 % fällig am 26.07.2026		3.243	3.023	0,17
Nissan Motor Co. Ltd.				
3,522 % fällig am 17.09.2025		2.000	1.861	0,10
4,345 % fällig am 17.09.2027		1.600	1.456	0,08
Skyworks Solutions, Inc.				
1,800 % fällig am 01.06.2026		100	89	0,01
Warnermedia Holdings, Inc.				
3,638 % fällig am 15.03.2025		2.100	2.027	0,11
3,755 % fällig am 15.03.2027		2.100	1.960	0,11
			13.136	0,73
VERSORGUNGSUNTERNEHMEN				
NextEra Energy Capital Holdings, Inc.				
6,051 % fällig am 01.03.2025		1.600	1.607	0,09
Pacific Gas & Electric Co.				
3,000 % fällig am 15.06.2028		500	431	0,02
			2.038	0,11
Summe Unternehmensanleihen und Wechsel			90.038	4,99
US-REGIERUNGSBEHÖRDEN				
Fannie Mae				
1,230 % fällig am 25.03.2037 (a)		240	17	0,00
3,000 % fällig am 25.10.2040		675	625	0,03
3,775 % fällig am 01.09.2035		7	7	0,00
3,805 % fällig am 01.07.2035		3	3	0,00
4,345 % fällig am 01.05.2038		180	182	0,01
4,715 % fällig am 01.01.2036		259	263	0,01
4,944 % fällig am 01.07.2044		1	1	0,00
5,516 % fällig am 01.11.2035		3	3	0,00
5,820 % fällig am 25.03.2038		319	318	0,02
Freddie Mac				
4,000 % fällig am 01.01.2048		1.533	1.463	0,08
4,021 % fällig am 01.09.2035		4	4	0,00
4,073 % fällig am 15.03.2042		184	177	0,01
4,122 % fällig am 15.07.2040		431	423	0,02
4,442 % fällig am 01.09.2037	$	344	$ 349	0,02
4,700 % fällig am 01.05.2031		0	0	0,00
5,066 % fällig am 01.06.2035		9	9	0,00
5,176 % fällig am 25.02.2045		16	15	0,00
Ginnie Mae				
2,625 % fällig am 20.08.2024 - 20.07.2027		9	8	0,00
2,750 % fällig am 20.10.2029		7	7	0,00
2,875 % fällig am 20.04.2026 - 20.04.2041		145	141	0,01
3,000 % fällig am 20.05.2047		304	283	0,02
4,643 % fällig am 20.10.2065 - 20.02.2066		8	8	0,00
4,770 % fällig am 20.01.2066		195	192	0,01
4,939 % fällig am 20.03.2066		361	358	0,02
5,431 % fällig am 20.06.2067		664	663	0,04
Uniform Mortgage-Backed Security				
6,500 % fällig am 01.10.2036		28	29	0,00
Uniform Mortgage-Backed Security, TBA				
5,500 % fällig am 01.08.2053		32.400	32.241	1,79
6,000 % fällig am 01.08.2053		23.700	23.906	1,33
6,500 % fällig am 01.07.2053		45.300	46.239	2,56
			107.934	5,98
US-SCHATZOBLIGATIONEN				
U.S. Treasury Inflation Protected Securities (e)				
0,125 % fällig am 15.07.2024		32.190	31.228	1,73
U.S. Treasury Notes				
0,375 % fällig am 30.09.2027		100	85	0,00
0,500 % fällig am 31.10.2027		1.200	1.025	0,06
0,625 % fällig am 30.11.2027		12.800	10.965	0,61
0,625 % fällig am 31.12.2027		10.700	9.145	0,51
0,750 % fällig am 31.01.2028		3.100	2.660	0,15
			55.108	3,06
NON-AGENCY-MBS				
245 Park Avenue Trust				
3,508 % fällig am 05.06.2037		9.903	8.821	0,49
American Home Mortgage Assets Trust				
5,530 % fällig am 25.09.2046 ^		100	85	0,01
American Home Mortgage Investment Trust				
5,430 % fällig am 25.03.2046		312	270	0,02
Ashford Hospitality Trust				
6,569 % fällig am 15.04.2035		6.200	6.027	0,33
Avon Finance PLC				
5,809 % fällig am 20.09.2048	£	2.156	2.740	0,15
Banc of America Funding Trust				
3,758 % fällig am 26.10.2036	$	3.930	3.574	0,20
4,381 % fällig am 25.05.2035		2	2	0,00
4,449 % fällig am 20.02.2036		10	10	0,00
Barclays Commercial Mortgage Securities Trust				
6,384 % fällig am 15.07.2037		800	778	0,04
Bear Stearns Adjustable Rate Mortgage Trust				
4,201 % fällig am 25.01.2034		5	5	0,00
Bear Stearns ALT-A Trust				
3,781 % fällig am 25.11.2036		3.251	1.846	0,10
3,932 % fällig am 25.08.2036 ^		595	414	0,02
4,202 % fällig am 25.09.2035 ^		6	4	0,00
4,365 % fällig am 25.01.2036 ^		31	28	0,00
4,636 % fällig am 25.07.2035		840	589	0,03
6,725 % fällig am 25.01.2035		1.481	1.361	0,08
Bear Stearns Mortgage Funding Trust				
5,320 % fällig am 25.06.2047		330	278	0,02
5,330 % fällig am 25.10.2036		1.383	1.172	0,07
Bear Stearns Structured Products, Inc. Trust				
3,484 % fällig am 26.12.2046 ^		481	363	0,02
4,098 % fällig am 26.01.2036 ^		1.651	1.322	0,07
Braemar Hotels & Resorts Trust				
6,138 % fällig am 15.06.2035		116	115	0,01
Brants Bridge PLC				
0,000 % fällig am 14.06.2066 (b)	£	1.000	1.265	0,07
BX Trust				
6,463 % fällig am 15.05.2035	$	7.010	6.915	0,38
Canada Square Funding PLC				
5,682 % fällig am 17.06.2058	£	2.491	3.150	0,18
Citigroup Commercial Mortgage Trust				
6,148 % fällig am 15.12.2036	$	1.000	985	0,05
Citigroup Mortgage Loan Trust				
4,418 % fällig am 25.08.2035 ^	$	59	$ 48	0,00
6,980 % fällig am 25.05.2035		1	1	0,00
7,110 % fällig am 25.10.2035 ^		32	31	0,00
Countrywide Alternative Loan Trust				
4,976 % fällig am 25.12.2035		652	549	0,03
5,350 % fällig am 25.04.2047		1.749	1.647	0,09
5,352 % fällig am 20.12.2046 ^		55	46	0,00
5,360 % fällig am 25.04.2047		1.393	1.132	0,06
5,450 % fällig am 25.06.2035 ^		900	613	0,03
5,470 % fällig am 25.02.2047		68	62	0,00
5,510 % fällig am 25.05.2047		254	219	0,01
5,570 % fällig am 25.07.2046		3.827	3.394	0,19
5,750 % fällig am 25.04.2037 ^		594	501	0,03
Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust				
5,610 % fällig am 25.05.2035		3.081	2.609	0,14
5,930 % fällig am 25.02.2035		3.221	2.780	0,15
Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp.				
0,098 % fällig am 25.06.2032		0	0	0,00
5,449 % fällig am 25.03.2032		1	1	0,00
Credit Suisse Mortgage Capital Certificates				
3,581 % fällig am 27.12.2037		4.555	3.864	0,21
Credit Suisse Mortgage Capital Trust				
3,850 % fällig am 25.09.2057		8.887	8.521	0,47
5,943 % fällig am 15.07.2032		567	541	0,03
CSAIL Commercial Mortgage Trust				
3,504 % fällig am 15.06.2057		4.030	3.837	0,21
DBWF Mortgage Trust				
6,596 % fällig am 19.12.2030		1.400	1.374	0,08
Dutch Property Finance BV				
3,892 % fällig am 28.07.2058	€	2.902	3.162	0,18
3,942 % fällig am 28.04.2059		10.633	11.545	0,64
4,492 % fällig am 28.04.2050		3.686	3.958	0,22
4,992 % fällig am 28.04.2050		9.579	9.828	0,55
GSR Mortgage Loan Trust				
5,500 % fällig am 25.01.2034	$	1	1	0,00
HarborView Mortgage Loan Trust				
4,688 % fällig am 19.08.2036 ^		19	18	0,00
5,597 % fällig am 19.05.2035		20	18	0,00
Hilton Orlando Trust				
6,493 % fällig am 15.12.2034		9.170	9.030	0,50
Hops Hill PLC				
0,000 % fällig am 21.12.2055	£	3.400	4.306	0,24
Impac CMB Trust				
5,690 % fällig am 25.05.2035	$	3.525	3.257	0,18
5,910 % fällig am 25.10.2033		0	0	0,00
Independence Plaza Trust				
3,911 % fällig am 10.07.2035		4.300	3.983	0,22
JPMorgan Alternative Loan Trust				
6,500 % fällig am 25.03.2036 ^		1.421	827	0,05
JPMorgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust				
6,543 % fällig am 15.02.2035		6.201	6.006	0,33
JPMorgan Mortgage Trust				
3,951 % fällig am 25.04.2036 ^		637	562	0,03
Jupiter Mortgage PLC				
5,291 % fällig am 20.07.2060	£	11.540	14.651	0,81
Lehman XS Trust				
5,510 % fällig am 25.11.2035	$	3.366	3.249	0,18
5,510 % fällig am 25.07.2037 ^		9.219	8.470	0,47
5,690 % fällig am 25.12.2035		4.689	4.185	0,23
London Wall Mortgage Capital PLC				
5,452 % fällig am 15.05.2051	£	6.962	8.795	0,49
5,502 % fällig am 15.05.2052		5.900	7.442	0,41
Luminent Mortgage Trust				
5,550 % fällig am 25.10.2046	$	151	135	0,01
MASTR Adjustable Rate Mortgages Trust				
4,776 % fällig am 25.12.2046		9.656	7.368	0,41
Mellon Residential Funding Corp. Mortgage Pass-Through Trust				
5,673 % fällig am 15.06.2030		4	4	0,00
Merrill Lynch Mortgage Investors Trust				
4,015 % fällig am 25.12.2034		5	5	0,00
5,570 % fällig am 25.02.2036		6	6	0,00
5,610 % fällig am 25.04.2029		111	102	0,01
5,650 % fällig am 25.11.2035		3	3	0,00
6,164 % fällig am 25.12.2029		107	97	0,01
Mortimer BTL PLC				
5,614 % fällig am 23.06.2053	£	465	584	0,03

BESCHREIBUNG		PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
Nomura Resecuritization Trust				
6,050 % fällig am 25.03.2037	$	0	$ 0	0,00
Pierpont BTL PLC				
5,714 % fällig am 22.12.2053	£	11.507	14.551	0,81
Polaris PLC				
5,631 % fällig am 23.12.2058		1.402	1.774	0,10
Prime Mortgage Trust				
5,550 % fällig am 25.02.2034	$	18	17	0,00
Primrose Residential DAC				
4,189 % fällig am 24.03.2061	€	2.143	2.322	0,13
Residential Accredit Loans, Inc. Trust				
6,500 % fällig am 25.08.2036	$	963	777	0,04
Residential Funding Mortgage Securities, Inc. Trust				
4,149 % fällig am 25.09.2035 ^		438	283	0,02
Sequoia Mortgage Trust				
5,757 % fällig am 20.12.2034		234	210	0,01
Shamrock Residential DAC				
4,289 % fällig am 24.01.2061	€	19.606	21.166	1,17
Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust				
5,282 % fällig am 25.02.2034	$	9	9	0,00
5,376 % fällig am 25.01.2035 ^		20	17	0,00
5,470 % fällig am 25.10.2035		2.006	1.836	0,10
Structured Asset Mortgage Investments Trust				
5,330 % fällig am 25.09.2047		617	560	0,03
5,376 % fällig am 25.12.2035 ^		52	42	0,00
5,646 % fällig am 19.07.2035		15	13	0,00
5,710 % fällig am 25.02.2036 ^		8	7	0,00
Tharaldson Hotel Portfolio Trust				
6,591 % fällig am 11.11.2034		3.159	3.110	0,17
Thornburg Mortgage Securities Trust				
5,790 % fällig am 25.09.2043		335	317	0,02
Towd Point Mortgage Funding PLC				
6,546 % fällig am 20.02.2054	£	225	286	0,02
Towd Point Mortgage Trust				
3,750 % fällig am 25.10.2056	$	8.100	7.613	0,42
Tower Bridge Funding PLC				
5,399 % fällig am 21.07.2064	£	7.994	10.159	0,56
Twin Bridges PLC				
0,000 % fällig am 14.06.2055		1.000	1.267	0,07
5,635 % fällig am 01.12.2055		7.548	9.515	0,53
Verus Securitization Trust				
1,829 % fällig am 25.10.2066	$	6.091	5.187	0,29
WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust				
3,693 % fällig am 25.08.2046 ^		26	23	0,00
3,800 % fällig am 25.10.2035		233	211	0,01
4,676 % fällig am 25.03.2047 ^		2.064	1.792	0,10
5,690 % fällig am 25.12.2045		6	6	0,00
5,730 % fällig am 25.10.2045		3	3	0,00
6,070 % fällig am 25.10.2044		426	394	0,02
6,130 % fällig am 25.10.2045		1.830	1.723	0,10
6,310 % fällig am 25.11.2045		917	859	0,05
Wells Fargo Commercial Mortgage Trust				
4,218 % fällig am 15.07.2046		479	477	0,03
Wells Fargo Mortgage-Backed Securities Trust				
4,709 % fällig am 25.04.2036		1.617	1.535	0,09
			273.547	15,16

FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE

BESCHREIBUNG		PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
Aames Mortgage Investment Trust				
6,065 % fällig am 25.10.2035		2.900	2.691	0,15
ACE Securities Corp. Home Equity Loan Trust				
5,470 % fällig am 25.10.2036		3.981	1.516	0,08
Ameriquest Mortgage Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates				
6,020 % fällig am 25.11.2035		3.026	2.806	0,16
6,065 % fällig am 25.09.2035		6.000	5.462	0,30
6,110 % fällig am 25.10.2035		1.700	1.523	0,08
Ares European CLO DAC				
3,837 % fällig am 15.10.2030	€	1.192	1.277	0,07
3,957 % fällig am 15.10.2031		1.000	1.072	0,06
Asset-Backed European Securitisation Transaction Twenty-One BV				
4,072 % fällig am 21.09.2031		1.000	1.095	0,06
Asset-Backed Funding Certificates Trust				
5,470 % fällig am 25.11.2036	$	6.166	2.702	0,15
AutoFlorence SRL				
4,334 % fällig am 25.12.2046	€	1.500	1.640	0,09
Avoca CLO DAC				
3,997 % fällig am 15.10.2032	€	4.200	$ 4.480	0,25
Bain Capital Euro CLO DAC				
3,940 % fällig am 20.01.2032		696	743	0,04
Bavarian Sky S.A.				
3,765 % fällig am 20.03.2030		823	899	0,05
4,055 % fällig am 20.05.2027		301	329	0,02
4,055 % fällig am 20.07.2029		4.806	5.249	0,29
Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust				
5,470 % fällig am 25.08.2036	$	452	430	0,02
5,490 % fällig am 25.12.2036		1.000	950	0,05
5,650 % fällig am 25.05.2037		2.125	1.996	0,11
Black Diamond CLO DAC				
2,500 % fällig am 15.05.2032		4.000	3.764	0,21
4,060 % fällig am 20.01.2032	€	837	900	0,05
4,303 % fällig am 15.05.2032		22.300	23.805	1,32
BlueMountain Fuji EUR CLO DAC				
3,827 % fällig am 15.07.2030		366	392	0,02
Bumper FR				
4,113 % fällig am 27.04.2032		13.430	14.687	0,81
Bumper NL BV				
4,613 % fällig am 24.06.2031		3.598	3.939	0,22
Cairn CLO DAC				
3,842 % fällig am 30.04.2031		1.183	1.265	0,07
3,912 % fällig am 31.01.2030		426	458	0,03
3,957 % fällig am 15.10.2031		600	642	0,04
Carlyle Euro CLO DAC				
3,877 % fällig am 15.01.2031		796	851	0,05
4,213 % fällig am 15.08.2032		5.700	6.079	0,34
Carlyle Global Market Strategies Euro CLO DAC				
4,137 % fällig am 16.01.2033		7.400	7.825	0,43
Carlyle Global Market Strategies Euro CLO Ltd.				
4,073 % fällig am 15.11.2031		800	856	0,05
Carrington Mortgage Loan Trust				
6,140 % fällig am 25.06.2035	$	423	412	0,02
Chase Funding Trust				
5,890 % fällig am 25.10.2032		2	2	0,00
CIT Mortgage Loan Trust				
6,500 % fällig am 25.10.2037		376	376	0,02
Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.				
6,800 % fällig am 25.07.2037		518	516	0,03
Citizen Irish Auto Receivables Trust DAC				
4,148 % fällig am 15.12.2029	€	1.568	1.713	0,10
Compartment VCL				
3,802 % fällig am 21.01.2029		2.691	2.939	0,16
3,842 % fällig am 21.04.2029		900	983	0,05
4,072 % fällig am 21.09.2026		269	294	0,02
Countrywide Asset-Backed Certificates				
5,550 % fällig am 25.08.2034	$	112	104	0,01
Countrywide Asset-Backed Certificates Trust				
4,134 % fällig am 25.01.2037		120	119	0,01
5,290 % fällig am 25.08.2037		167	165	0,01
5,430 % fällig am 25.02.2037		922	870	0,05
5,430 % fällig am 25.03.2037		1.021	981	0,05
5,690 % fällig am 25.03.2036		583	503	0,03
6,155 % fällig am 25.10.2035		155	153	0,01
6,245 % fällig am 25.07.2035		78	77	0,00
Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp.				
4,599 % fällig am 25.01.2032		2	2	0,00
Credit-Based Asset Servicing & Securitization LLC				
6,725 % fällig am 25.03.2046		1.500	1.377	0,08
CVC Cordatus Loan Fund DAC				
4,156 % fällig am 15.09.2031	€	900	961	0,05
Dryden Euro CLO DAC				
4,183 % fällig am 15.05.2034		1.000	1.068	0,06
Ellington Loan Acquisition Trust				
6,200 % fällig am 25.05.2037	$	1.786	1.679	0,09
EquiFirst Mortgage Loan Trust				
6,875 % fällig am 25.12.2034		449	426	0,02
FACT Master S.A.				
4,055 % fällig am 20.07.2028	€	1.656	1.811	0,10
First Franklin Mortgage Loan Trust				
5,630 % fällig am 25.05.2036	$	6.681	5.513	0,31
Fremont Home Loan Trust				
5,490 % fällig am 25.02.2037		3.955	1.358	0,08
Gallatin CLO Ltd.				
6,311 % fällig am 21.01.2028		222	222	0,01
GE-WMC Asset-Backed Pass-Through Certificates				
5,790 % fällig am 25.12.2035	$	3.478	$ 3.282	0,18
Ginkgo Sales Finance				
4,113 % fällig am 25.11.2049	€	3.433	3.747	0,21
Greystone Commercial Real Estate Notes Ltd.				
6,373 % fällig am 15.09.2037	$	946	934	0,05
GSAA Home Equity Trust				
5,650 % fällig am 25.01.2036		998	372	0,02
GSAMP Trust				
5,290 % fällig am 25.12.2036		1.007	545	0,03
5,450 % fällig am 25.09.2036		2.782	1.013	0,06
5,630 % fällig am 25.03.2046		587	567	0,03
6,050 % fällig am 25.11.2035 ^		1.550	1.451	0,08
Harvest CLO DAC				
3,937 % fällig am 15.07.2031	€	900	958	0,05
4,250 % fällig am 26.06.2030		354	379	0,02
Hill FL BV				
4,050 % fällig am 18.05.2030		7.972	8.726	0,48
4,110 % fällig am 18.05.2031		7.400	8.091	0,45
Home Equity Asset Trust				
4,279 % fällig am 25.10.2035	$	2.900	2.780	0,15
5,855 % fällig am 25.01.2036		1.012	956	0,05
HSI Asset Securitization Corp. Trust				
5,930 % fällig am 25.01.2036		1.200	939	0,05
JPMorgan Mortgage Acquisition Corp.				
6,080 % fällig am 25.12.2035		1.339	1.282	0,07
JPMorgan Mortgage Acquisition Trust				
5,410 % fällig am 25.06.2037		168	167	0,01
5,430 % fällig am 25.03.2047		610	566	0,03
5,585 % fällig am 25.05.2036		532	499	0,03
Jubilee CLO DAC				
3,777 % fällig am 15.04.2030	€	400	426	0,02
3,787 % fällig am 15.04.2030		1.000	1.069	0,06
3,827 % fällig am 15.04.2031		1.200	1.278	0,07
4,326 % fällig am 15.12.2029		668	720	0,04
Koromo Italy SRL				
4,213 % fällig am 26.02.2035		954	1.044	0,06
Laurelin DAC				
3,920 % fällig am 20.10.2031		1.100	1.178	0,07
Long Beach Mortgage Loan Trust				
5,590 % fällig am 25.02.2036	$	1.060	1.026	0,06
5,710 % fällig am 25.10.2034		5	4	0,00
5,750 % fällig am 25.01.2036		353	322	0,02
LT Autorahoitus DAC				
4,040 % fällig am 18.07.2033	€	9.400	10.263	0,57
4,250 % fällig am 17.12.2032		11.869	13.020	0,72
Man GLG Euro CLO DAC				
3,857 % fällig am 15.10.2030		513	549	0,03
4,047 % fällig am 15.01.2030		440	474	0,03
4,216 % fällig am 15.12.2031		999	1.070	0,06
Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust				
5,280 % fällig am 25.10.2036	$	725	641	0,04
5,650 % fällig am 25.04.2036		1.739	1.606	0,09
6,005 % fällig am 25.03.2034		989	970	0,05
6,065 % fällig am 25.07.2034		1.033	1.030	0,06
6,065 % fällig am 25.09.2034		1.528	1.471	0,08
Morgan Stanley Home Equity Loan Trust				
5,470 % fällig am 25.04.2036		197	139	0,01
Morgan Stanley Mortgage Loan Trust				
5,330 % fällig am 25.12.2036		1.877	749	0,04
Nomura Home Equity Loan, Inc. Home Equity Loan Trust				
5,780 % fällig am 25.02.2036		1.477	1.311	0,07
Oak Hill European Credit Partners Ltd.				
4,100 % fällig am 22.07.2030	€	134	146	0,01
Option One Mortgage Loan Trust				
5,370 % fällig am 25.04.2037	$	2.047	1.460	0,08
Option One Mortgage Loan Trust Asset-Backed Certificates				
5,885 % fällig am 25.11.2035		274	220	0,01
OZLME DAC				
4,618 % fällig am 27.07.2032	€	1.440	1.518	0,08
Palmer Square European Loan Funding DAC				
4,727 % fällig am 15.11.2032		600	654	0,04
Park Place Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates				
6,470 % fällig am 25.01.2036 ^	$	1.000	910	0,05
Popular ABS Mortgage Pass-Through Trust				
6,020 % fällig am 25.02.2036		1.700	1.532	0,09

BESCHREIBUNG		PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
RAAC Trust				
6,650 % fällig am 25.09.2047	$	3.164	$ 3.025	0,17
Red & Black Auto Lease France				
4,093 % fällig am 27.06.2035	€	1.000	1.091	0,06
Residential Asset Mortgage Products Trust				
5,690 % fällig am 25.02.2036	$	1.200	1.131	0,06
6,215 % fällig am 25.05.2035		2.000	1.872	0,10
Residential Asset Securities Corp. Trust				
5,430 % fällig am 25.07.2036		1.200	1.130	0,06
Revocar UG				
4,032 % fällig am 21.04.2036	€	1.076	1.178	0,07
Saxon Asset Securities Trust				
6,050 % fällig am 26.12.2034	$	240	225	0,01
SCF Rahoituspalvelut DAC				
4,020 % fällig am 25.06.2033	€	1.300	1.419	0,08
4,039 % fällig am 25.06.2032		1.501	1.639	0,09
Silver Arrow Athlon NL BV				
4,139 % fällig am 26.04.2031		13.315	14.552	0,81
Silver Arrow S.A.				
3,768 % fällig am 15.02.2030		6.984	7.627	0,42
Specialty Underwriting & Residential Finance Trust				
5,270 % fällig am 25.03.2037	$	4.819	2.700	0,15
5,650 % fällig am 25.06.2037		5.928	3.458	0,19
6,125 % fällig am 25.12.2035		104	102	0,01
Structured Asset Investment Loan Trust				
5,330 % fällig am 25.09.2036		6.786	4.275	0,24
5,770 % fällig am 25.01.2036		1.238	1.140	0,06
5,915 % fällig am 25.08.2035		1.552	1.471	0,08

BESCHREIBUNG		PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust				
5,420 % fällig am 25.03.2036	$	1.490	$ 1.372	0,08
5,460 % fällig am 25.08.2046		3.321	3.083	0,17
5,470 % fällig am 25.10.2036		1.642	1.147	0,06
5,570 % fällig am 25.02.2037		1.314	1.273	0,07
Toro European CLO DAC				
4,133 % fällig am 15.02.2034	€	5.100	5.415	0,30
Washington Mutual Asset-Backed Certificates Trust				
5,460 % fällig am 25.08.2036	$	866	811	0,05
Wells Fargo Home Equity Asset-Backed Securities Trust				
5,645 % fällig am 25.05.2036		393	391	0,02
			272.528	15,11
STAATSEMISSIONEN				
Korea Housing Finance Corp.				
0,010 % fällig am 05.02.2025	€	5.000	5.100	0,28
0,010 % fällig am 07.07.2025		5.000	5.014	0,28
0,723 % fällig am 22.03.2025		1.260	1.295	0,07
			11.409	0,63
KURZFRISTIGE INSTRUMENTE				
COMMERCIAL PAPER				
Ameren Corp.				
5,400 % fällig am 21.07.2023	$	8.550	8.523	0,47
Virginia Electric & Power Co.				
5,330 % fällig am 13.07.2023		2.800	2.795	0,16
			11.318	0,63

BESCHREIBUNG		PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
KURZFRISTIGE SCHULDTITEL				
Federal Home Loan Bank				
5,120 % fällig am 17.11.2023	$	15.300	$ 15.303	0,85
U.S. TREASURY BILLS				
5,156 % fällig am 03.08.2023 (c)(d)		40.000	39.824	2,21
5,177 % fällig am 15.08.2023 (c)(d)		30.000	29.816	1,65
5,242 % fällig am 20.07.2023 (c)(d)		80.000	79.811	4,42
5,339 % fällig am 31.08.2023 (c)(d)(g)		25.000	24.788	1,37
			174.239	9,65
Summe kurzfristige Instrumente			200.860	11,13
Summe Übertragbare Wertpapiere			**$ 1.011.424**	**56,06**
		AKTIEN		
INVESTMENTFONDS				
ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN				
PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (f)		16.371.646	163.028	9,04
Summe Investmentfonds			**$ 163.028**	**9,04**

PENSIONSGESCHÄFTE

Kontrahent	Kredit-zins	Abrechnungs-datum	Fälligkeits-datum	Kapital-betrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensions-geschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensions-geschäft[1]	% des Nettovermögens
BPS	5,100 %	30.06.2023	03.07.2023	$ 37.100	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.01.2030	$ (37.947)	$ 37.100	$ 37.116	2,06
	5,170	30.06.2023	03.07.2023	136.900	Ginnie Mae 2,500 % fällig am 20.10.2051	(141.714)	136.900	136.959	7,58
BRC	5,130	30.06.2023	03.07.2023	36.600	Ginnie Mae 2,500 % fällig am 20.08.2051	(37.494)	36.600	36.616	2,03
DEU	5,150	30.06.2023	03.07.2023	100	U.S. Treasury Bonds 2,750 % fällig am 15.08.2047	(104)	100	100	0,01
FICC	2,400	30.06.2023	03.07.2023	10.413	U.S. Treasury Notes 4,625 % fällig am 30.06.2025	(10.621)	10.413	10.413	0,58
GSC	5,160	30.06.2023	03.07.2023	130.000	Fannie Mae 3,000 % fällig am 01.04.2052	(134.655)	130.000	130.056	7,21
MFK	5,180	30.06.2023	03.07.2023	150.000	U.S. Treasury Bonds 4,750 % fällig am 15.02.2041	(153.649)	150.000	150.065	8,31
RVM	5,180	30.06.2023	03.07.2023	150.000	U.S. Treasury Notes 3,500 % fällig am 30.04.2030	(151.839)	150.000	150.065	8,31
Summe Pensionsgeschäfte						**$ (668.023)**	**$ 651.113**	**$ 651.390**	**36,09**

[1] Umfasst aufgelaufene Zinsen.

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

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

FUTURES

Beschreibung	Art	Ablauf-monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
E-mini S&P 500 Index September Futures	Long	09.2023	3.152	$ 19.819	1,10
Euro-Bund 10-Year Bond September Futures	Short	09.2023	72	99	0,01
U.S. Treasury 2-Year Note September Futures	Long	09.2023	33	(97)	(0,01)
U.S. Treasury 5-Year Note September Futures	Long	09.2023	91	(195)	(0,01)
U.S. Treasury 10-Year Note September Futures	Short	09.2023	355	740	0,04
U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond September Futures	Short	09.2023	8	(16)	0,00
United Kingdom Long Gilt September Futures	Short	09.2023	6	7	0,00
				$ 20.357	1,13
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate				**$ 20.357**	**1,13**

ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)

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

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMMISSIONEN - SCHUTZVERKAUF[1]

Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag[2]	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
AT&T, Inc.	1,000 %	20.12.2023	$ 6.300	$ (62)	(0,01)
AT&T, Inc.	1,000	20.06.2026	2.500	(24)	0,00
AT&T, Inc.	1,000	20.12.2026	1.100	(10)	0,00
AT&T, Inc.	1,000	20.06.2028	700	5	0,00
Boeing Co.	1,000	20.12.2023	3.100	(14)	0,00
Exelon Generation Co. LLC	1,000	20.12.2024	800	(1)	0,00
General Electric Co.	1,000	20.06.2026	1.700	6	0,00
General Electric Co.	1,000	20.12.2026	3.700	1	0,00
				$ (99)	(0,01)

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES - SCHUTZVERKAUF[1]

Index/Tranchen	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag[2]	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
CDX.IG-39 5-Year Index	1,000 %	20.12.2027	$ 4.500	$ 21	0,00
CDX.IG-40 5-Year Index	1,000	20.06.2028	304.500	1.468	0,08
				$ 1.489	0,08

ZINSSWAPS

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,750 %	15.06.2024	$ 237.900	$ 1.140	0,07
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,750	15.06.2027	22.900	(223)	(0,01)
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,750	15.06.2032	28.900	252	0,01
Erhalt[3]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,875	07.02.2050	300	135	0,01
Erhalt[3]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,000	15.01.2050	900	416	0,02
Erhalt[3]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,000	20.03.2050	1.900	867	0,05
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,750	21.06.2053	3.200	94	0,01
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,000	21.06.2030	7.100	201	0,01
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,000	21.06.2033	7.200	61	0,00
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,250	21.06.2028	12.300	247	0,01
Erhalt[3]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,500	20.12.2030	12.300	101	0,01
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,750	21.06.2025	41.100	(802)	(0,05)
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,750	21.06.2025	29.300	(9)	0,00
Erhalt[3]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,750	20.12.2028	16.700	131	0,01
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,875	07.08.2023	300	1	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,000	15.07.2023	900	3	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,000	20.09.2023	1.900	8	0,00
Erhalt[3]	6-Month EUR-EURIBOR	3,500	20.09.2025	€ 23.200	294	0,02
Erhalt	CPURNSA	2,418	11.07.2052	$ 5.700	153	0,01
					$ 3.070	0,18
Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate					**$ 4.460**	**0,25**

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

(2) Der maximal mögliche Betrag, den der Fonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

(3) Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft.

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

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

TOTAL RETURN SWAPS AUF INDIZES

Kontrahent	Zahlung/Erhalt	Wertpapier	Anzahl der Anteile oder Einheiten	Variabler Zinssatz	Nenn-betrag	Fälligkeits-datum	Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Markt-wert	% des Nettovermögens
CBK	Erhalt	S&P 500 Total Return Index	677	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	$ 6.071	10.01.2024	$ 0	$ 375	$ 375	0,02
FAR	Erhalt	S&P 500 Total Return Index	2.731	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	24.489	02.08.2023	0	1.512	1.512	0,08
	Erhalt	S&P 500 Total Return Index	167	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	1.498	15.11.2023	0	92	92	0,01
	Erhalt	S&P 500 Total Return Index	3.736	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	34.215	05.06.2024	0	1.386	1.386	0,08

Kontrahent	Zahlung/Erhalt	Wertpapier	Anzahl der Anteile oder Einheiten	Variabler Zinssatz	Nenn-betrag	Fälligkeits-datum	Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Markt-wert	% des Nettovermögens
	Erhalt	S&P 500 Total Return Index	21.307	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	$ 199.758	26.06.2024	$ 0	$ 3.687	$ 3.687	0,20
JPM	Erhalt	S&P 500 Total Return Index	16.775	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	157.269	18.10.2023	0	2.905	2.905	0,16
	Erhalt	S&P 500 Total Return Index	9.621	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	86.273	06.03.2024	0	5.327	5.327	0,29
	Erhalt	S&P 500 Total Return Index	5.404	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	48.459	20.03.2024	0	2.992	2.992	0,17
RBC	Erhalt	S&P 500 Total Return Index	24.342	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	218.279	19.07.2023	0	13.474	13.474	0,75
	Erhalt	S&P 500 Total Return Index	398	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	3.569	26.07.2023	0	220	220	0,01
	Erhalt	S&P 500 Total Return Index	6.655	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	62.392	18.10.2023	0	1.152	1.152	0,06
	Erhalt	S&P 500 Total Return Index	340	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	3.049	17.01.2024	0	188	188	0,01
	Erhalt	S&P 500 Total Return Index	5.593	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	49.360	24.01.2024	0	3.841	3.841	0,21
	Erhalt	S&P 500 Total Return Index	13.035	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	116.887	21.02.2024	0	7.220	7.220	0,41
	Erhalt	S&P 500 Total Return Index	340	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	3.049	15.05.2024	0	188	188	0,01
UBS	Erhalt	S&P 500 Total Return Index	2.522	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	22.615	13.09.2023	0	1.397	1.397	0,08
							$ 0	$ 45.956	$ 45.956	2,55

DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2023	DKK 10.803	$ 1.560	$ 0	$ (23)	$ (23)	0,00
	07.2023	€ 6.093	6.590	0	(57)	(57)	0,00
	07.2023	$ 2.881	DKK 19.592	0	(11)	(11)	0,00
	08.2023	DKK 19.559	$ 2.881	11	0	11	0,00
	09.2023	$ 6	TWD 176	0	0	0	0,00
BPS	07.2023	€ 1.430	$ 1.558	0	(2)	(2)	0,00
	07.2023	NZD 56	34	0	(1)	(1)	0,00
	07.2023	$ 274.541	€ 250.565	0	(1.175)	(1.175)	(0,07)
	07.2023	4.772	£ 3.750	0	(5)	(5)	0,00
	08.2023	€ 249.045	$ 273.261	1.183	0	1.183	0,07
	08.2023	$ 3	TWD 88	0	0	0	0,00
	10.2023	32	ZAR 590	0	(1)	(1)	0,00
BRC	07.2023	£ 13.681	$ 17.028	0	(366)	(366)	(0,02)
CBK	07.2023	€ 842	909	0	(10)	(10)	0,00
	07.2023	£ 12.034	15.093	0	(206)	(206)	(0,01)
	07.2023	$ 24.791	€ 23.082	394	(3)	391	0,02
CLY	07.2023	DKK 31.749	$ 4.583	0	(69)	(69)	0,00
GLM	10.2023	$ 90	ZAR 1.695	0	(1)	(1)	0,00
JPM	07.2023	€ 27.140	$ 29.017	0	(592)	(592)	(0,03)
	07.2023	£ 817	1.033	0	(6)	(6)	0,00
	08.2023	$ 1.033	£ 817	6	0	6	0,00
MBC	07.2023	CAD 149	$ 110	0	(3)	(3)	0,00
	07.2023	£ 40.684	50.361	0	(1.362)	(1.362)	(0,08)
	07.2023	$ 6.538	€ 6.067	83	(2)	81	0,00
MYI	07.2023	€ 436	$ 475	0	(1)	(1)	0,00
	07.2023	$ 2.561	DKK 17.472	0	(1)	(1)	0,00
	08.2023	DKK 17.443	$ 2.561	1	0	1	0,00
	08.2023	$ 3	TWD 95	0	0	0	0,00
RBC	08.2023	13	MXN 222	0	0	0	0,00
SCX	07.2023	NZD 134	$ 81	0	(1)	(1)	0,00
SOG	07.2023	€ 244.209	262.705	0	(3.728)	(3.728)	(0,21)
TOR	07.2023	$ 87	CAD 115	0	0	0	0,00
	07.2023	80.646	£ 63.466	41	0	41	0,00
	07.2023	116	NZD 190	1	0	1	0,00
	08.2023	CAD 115	$ 87	0	0	0	0,00
	08.2023	£ 63.466	80.664	0	(40)	(40)	0,00
	08.2023	NZD 190	116	0	(1)	(1)	0,00
				$ 1.720	$ (7.667)	$ (5.947)	(0,33)

ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklassen Institutional EUR (Hedged) thesaurierend und Class E EUR (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2023	€ 16	$ 17	$ 0	$ 0	$ 0	0,00
	07.2023	$ 54.107	€ 50.344	819	0	819	0,05
BPS	07.2023	€ 59.902	$ 65.621	273	(6)	267	0,02

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
	07.2023	$ 53.681	€ 49.929	$ 792	$ 0	$ 792	0,04
	08.2023	63.825	58.169	0	(276)	(276)	(0,02)
CBK	07.2023	€ 54.491	$ 59.256	6	(199)	(193)	(0,01)
	07.2023	$ 2.851	€ 2.654	45	0	45	0,00
	08.2023	57.140	52.483	197	0	197	0,01
JPM	07.2023	€ 59.024	$ 64.448	53	0	53	0,00
	08.2023	$ 64.538	€ 59.024	0	(55)	(55)	0,00
MBC	07.2023	€ 1.272	$ 1.364	0	(24)	(24)	0,00
	07.2023	$ 454	€ 417	2	(1)	1	0,00
RYL	07.2023	23.285	21.764	459	0	459	0,03
SOG	07.2023	53.292	49.540	756	0	756	0,04
				$ 3.402	$ (561)	$ 2.841	0,16

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklasse Institutional GBP (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2023	£ 1	$ 1	$ 0	$ 0	$ 0	0,00
	07.2023	$ 46	£ 37	1	0	1	0,00
CBK	07.2023	3	2	0	(1)	(1)	0,00
CLY	07.2023	168	133	1	0	1	0,00
MBC	07.2023	£ 2	$ 2	0	0	0	0,00
	07.2023	$ 39	£ 31	1	0	1	0,00
MYI	07.2023	39	31	1	0	1	0,00
SCX	07.2023	39	31	1	0	1	0,00
				$ 5	$ (1)	$ 4	0,00

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklasse Institutional SGD (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BRC	07.2023	SGD 1	$ 1	$ 0	$ 0	$ 0	0,00
	07.2023	$ 111	SGD 151	0	0	0	0,00
CLY	07.2023	3	4	0	0	0	0,00
MBC	07.2023	92	124	0	0	0	0,00
SCX	07.2023	SGD 3	$ 3	0	0	0	0,00
	07.2023	$ 102	SGD 138	0	0	0	0,00
				$ 0	$ 0	$ 0	0,00

Summe Freiverkehrsfinanzderivate	**$ 42.854**	**2,38**
Summe Anlagen	**$ 1.893.236**	**104,95**
Sonstige Aktiva und Passiva	**$ (89.277)**	**(4,95)**
Nettovermögen	**$ 1.803.959**	**100,00**

ERLÄUTERUNGEN ZUR AUFSTELLUNG DES WERTPAPIERBESTANDS (Angaben in Tausend*):

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

^ **Das Wertpapier ist in Verzug.**

(a) **Bei dem Wertpapier handelt es sich um ein Interest Only- („IO“) bzw. IO-Strip.**

(b) **Wertpapier per Emissionstermin.**

(c) **Nullkuponwertpapier.**

(d) **Der Kupon stellt eine Rendite bis zur Endfälligkeit dar.**

(e) **Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.**

(f) **Mit dem Fonds verbunden.**

(g) **Wertpapier mit einem gesamten beizulegenden Zeitwert von 1.292 USD (31. Dezember 2022: null USD) und Barmittel in Höhe von 2.200 USD (31. Dezember 2022: 40.550 USD) wurden zum 30. Juni 2023 gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. als Sicherheit für Finanzderivate verpfändet.**

Barmittel in Höhe von 58.286 USD (31. Dezember 2022: 45.395 USD) wurden zum 30. Juni 2023 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Beizulegender Zeitwert[1]

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 30. Juni 2023 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie[2]	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	$ 0	$ 1.011.308	$ 116	$ 1.011.424
Investmentfonds	163.028	0	0	163.028
Pensionsgeschäfte	0	651.113	0	651.113
Finanzderivate[3]	19.925	47.746	0	67.671
Summen	**$ 182.953**	**$ 1.710.167**	**$ 116**	**$ 1.893.236**

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

Kategorie[2]	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	$ 0	$ 711.694	$ 0	$ 711.694
Investmentfonds	92.742	0	0	92.742
Pensionsgeschäfte	0	156.445	0	156.445
Finanzderivate[3]	(14.139)	(3.519)	0	(17.658)
Summen	**$ 78.603**	**$ 864.620**	**$ 0**	**$ 943.223**

(1) Weitere Informationen finden Sie in den Erläuterungen in Erläuterung 3.

(2) Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung des Wertpapierbestands.

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

Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC-Finanzderivate und -Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2023 und 31. Dezember 2022:

	Zum 30. Jun. 2023			Zum 31. Dez. 2022		
Kontrahent	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-engagement[1]	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-engagement[1]
AZD	$ k. A.	$ k. A.	$ k. A.	$ (653)	$ 580	$ (73)
BOA	740	(580)	160	(428)	290	(138)
BPS	782	(850)	(68)	4	0	4
BRC	(366)	343	(23)	9	0	9
CBK	598	(560)	38	2.647	(2.506)	141
CLY	(68)	0	(68)	(53)	0	(53)
FAR	6.677	(3.480)	3.197	(1.148)	18.390	17.242
GLM	(1)	0	(1)	(184)	0	(184)
JPM	10.630	(6.960)	3.670	753	(700)	53
MBC	(1.306)	949	(357)	(1.953)	3.760	1.807
MYI	0	(10)	(10)	(224)	0	(224)
RBC	26.283	(20.470)	5.813	(1.063)	16.910	15.847
RYL	459	(490)	(31)	k. A.	k. A.	k. A.
SCX	k. A.	k. A.	k. A.	2.420	(2.270)	150
SOG	(2.972)	2.200	(772)	k. A.	k. A.	k. A.
TOR	1	0	1	k. A.	k. A.	k. A.
UAG	0	(970)	(970)	2	620	622
UBS	1.397	0	1.397	(35)	0	(35)

(1) Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären.

Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung des Wertpapierbestands zum 30. Juni 2023:

	30. Jun. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	39,76	33,61
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	16,30	35,70
Sonstige übertragbare Wertpapiere	k. A.	1,24
Investmentfonds	9,04	9,19
Pensionsgeschäfte	36,09	15,52
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	1,13	(1,39)
Zentral abgerechnete Finanzderivate	0,25	(0,37)
Freiverkehrsfinanzderivate	2,38	0,01

Das Anlageportfolio des Fonds konzentriert sich zum 30. Juni 2023 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	30. Jun. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
Unternehmensanleihen und Wechsel	4,99	6,99
US-Regierungsbehörden	5,98	0,59
US-Schatzobligationen	3,06	k. A.
Non-Agency-MBS	15,16	25,04
Forderungsbesicherte Wertpapiere	15,11	22,85
Staatsemissionen	0,63	k. A.
Kurzfristige Instrumente	11,13	15,08
Investmentfonds	9,04	9,19
Pensionsgeschäfte	36,09	15,52
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	1,13	(1,39)
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	(0,01)	(0,10)
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzkauf	k. A.	(0,30)
Credit Default Swaps auf Kreditindizes— Schutzverkauf	0,08	0,00
Zinsswaps	0,18	0,03
Freiverkehrsfinanzderivate		
Total Return Swaps auf Indizes	2,55	(0,24)
Devisenterminkontrakte	(0,33)	(0,30)
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	0,16	0,55
Sonstige Aktiva und Passiva	(4,95)	6,49
Nettovermögen	100,00	100,00

BESCHREIBUNG		PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
BANKEN UND FINANZEN				
Avolon Holdings Funding Ltd.				
2,528 % fällig am 18.11.2027	$	43	$ 36	0,31
Goldman Sachs Group, Inc.				
6,941 % fällig am 15.03.2028		100	102	0,88
Nissan Motor Acceptance Co. LLC				
2,750 % fällig am 09.03.2028		50	41	0,36
Nykredit Realkredit A/S				
1,500 % fällig am 01.10.2053	DKK	700	77	0,67
Wells Fargo & Co.				
1,338 % fällig am 04.05.2025	€	100	106	0,92
			362	3,14
INDUSTRIEWERTE				
Expedia Group, Inc.				
6,250 % fällig am 01.05.2025	$	44	44	0,38
VERSORGUNGSUNTERNEHMEN				
Pacific Gas & Electric Co.				
4,550 % fällig am 01.07.2030		5	5	0,04
Summe Unternehmensanleihen und Wechsel			411	3,56
US-REGIERUNGSBEHÖRDEN				
Freddie Mac				
5,176 % fällig am 25.02.2045		44	42	0,36
Uniform Mortgage-Backed Security, TBA				
4,000 % fällig am 01.08.2053		700	658	5,70
5,000 % fällig am 01.09.2053		200	196	1,70
5,500 % fällig am 01.08.2053		400	398	3,45
6,000 % fällig am 01.07.2053		200	202	1,75
6,500 % fällig am 01.07.2053		300	306	2,65
			1.802	15,61
US-SCHATZOBLIGATIONEN				
U.S. Treasury Inflation Protected Securities (c)				
0,625 % fällig am 15.07.2032		209	192	1,66
NON-AGENCY-MBS				
American Home Mortgage Assets Trust				
4,896 % fällig am 25.11.2046		238	73	0,63
Banc of America Alternative Loan Trust				
6,000 % fällig am 25.03.2021 ^		12	9	0,08
Banc of America Mortgage Trust				
5,188 % fällig am 25.06.2034		5	4	0,03
Bear Stearns Adjustable Rate Mortgage Trust				
4,541 % fällig am 25.05.2037		11	9	0,08
Chase Mortgage Finance Trust				
4,529 % fällig am 25.07.2037		2	1	0,01
Countrywide Alternative Loan Trust				
4,976 % fällig am 25.12.2035		22	20	0,17
5,500 % fällig am 25.11.2035		13	9	0,08

BESCHREIBUNG		PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
5,915 % fällig am 25.11.2035	$	35	$ 19	0,16
Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust				
5,610 % fällig am 25.05.2035		80	68	0,59
Countrywide Home Loan Reperforming REMIC Trust				
5,590 % fällig am 25.11.2034		10	10	0,09
CSAIL Commercial Mortgage Trust				
3,504 % fällig am 15.06.2057		100	95	0,82
Dutch Property Finance BV				
4,492 % fällig am 28.04.2050	€	46	50	0,43
Frost CMBS DAC				
4,533 % fällig am 20.11.2033		99	104	0,90
GSR Mortgage Loan Trust				
3,657 % fällig am 25.11.2035	$	16	14	0,12
Mortgage Equity Conversion Asset Trust				
5,720 % fällig am 25.02.2042		91	88	0,76
Precise Mortgage Funding PLC				
6,065 % fällig am 12.12.2055	£	56	71	0,62
Shamrock Residential DAC				
4,289 % fällig am 24.01.2061	€	83	89	0,77
Structured Asset Mortgage Investments Trust				
5,646 % fällig am 19.07.2035	$	22	20	0,17
5,770 % fällig am 25.09.2045		11	10	0,09
Structured Asset Securities Corp.				
5,430 % fällig am 25.01.2036		11	9	0,08
5,500 % fällig am 25.03.2035		41	35	0,30
			807	6,98
FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE				
Ares European CLO DAC				
3,837 % fällig am 15.10.2030	€	99	106	0,92
Armada Euro CLO DAC				
3,897 % fällig am 15.07.2031		100	107	0,92
Avoca CLO DAC				
3,867 % fällig am 15.07.2030		73	78	0,67
Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust				
5,470 % fällig am 25.08.2036	$	80	76	0,66
6,400 % fällig am 25.08.2037		15	15	0,13
Carlyle Global Market Strategies Euro CLO DAC				
4,137 % fällig am 16.01.2033	€	100	106	0,92
Contego CLO DAC				
3,851 % fällig am 23.01.2030		100	107	0,93
Fremont Home Loan Trust				
5,765 % fällig am 25.11.2035	$	100	86	0,74
Griffith Park CLO DAC				
4,103 % fällig am 21.11.2031	€	100	107	0,93
GSAA Home Equity Trust				
7,025 % fällig am 25.02.2035	$	100	96	0,83
GSAMP Trust				
5,290 % fällig am 25.12.2036		141	76	0,66
Home Equity Loan Trust				
5,380 % fällig am 25.04.2037		69	67	0,58
HSI Asset Securitization Corp. Trust				
5,930 % fällig am 25.01.2036		100	78	0,67

BESCHREIBUNG		PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
JPMorgan Mortgage Acquisition Trust				
5,360 % fällig am 25.10.2036	$	24	$ 23	0,20
Jubilee CLO DAC				
3,787 % fällig am 15.04.2030	€	100	107	0,93
Man GLG Euro CLO DAC				
4,047 % fällig am 15.01.2030		44	47	0,41
Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust				
6,005 % fällig am 25.03.2034	$	62	60	0,52
Mountain View CLO Ltd.				
6,592 % fällig am 13.10.2027		196	196	1,70
Oak Hill European Credit Partners DAC				
3,930 % fällig am 20.01.2032	€	93	99	0,86
Palmer Square European Loan Funding DAC				
4,727 % fällig am 15.11.2032		100	109	0,94
5,025 % fällig am 12.04.2032		95	105	0,91
Pretium Mortgage Credit Partners LLC				
2,240 % fällig am 27.09.2060	$	104	98	0,85
			1.949	16,88
KURZFRISTIGE INSTRUMENTE				
KURZFRISTIGE SCHULDTITEL				
Federal Home Loan Bank				
5,120 % fällig am 17.11.2023		500	500	4,33
JAPAN TREASURY BILLS				
(0,206) % fällig am 18.07.2023 (a)(b)	¥	20.000	138	1,19
(0,200) % fällig am 14.08.2023 (a)(b)		20.000	139	1,20
(0,197) % fällig am 31.07.2023 (a)(b)		23.000	159	1,38
(0,188) % fällig am 18.07.2023 (a)(b)		10.000	69	0,60
(0,186) % fällig am 07.08.2023 (a)(b)		20.000	138	1,20
(0,178) % fällig am 31.07.2023 (a)(b)		7.000	49	0,42
(0,176) % fällig am 14.08.2023 (a)(b)		10.000	69	0,60
(0,166) % fällig am 07.08.2023 (a)(b)		10.000	69	0,60
			830	7,19
U.S. TREASURY BILLS				
5,166 % fällig am 08.08.2023 (a)(b)	$	1.000	995	8,63
Summe kurzfristige Instrumente			2.325	20,15
Summe Übertragbare Wertpapiere			**$ 7.486**	**64,84**
		AKTIEN		
INVESTMENTFONDS				
ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN				
PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (d)		74.314	740	6,40
BÖRSENGEHANDELTE FONDS				
PIMCO ETFs plc - PIMCO US Dollar Short Maturity UCITS ETF (d)		3.800	377	3,27
Summe Investmentfonds			**$ 1.117**	**9,67**

PENSIONSGESCHÄFTE

Kontrahent	Kredit-zins	Abrechnungs-datum	Fälligkeits-datum	Kapital-betrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensions-geschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensions-geschäft[1]	% des Nettovermögens
BPS	5,160 %	30.06.2023	03.07.2023	$ 2.100	U.S. Treasury Notes 2,000 % fällig am 15.08.2025	$ (2.145)	$ 2.100	$ 2.101	18,19
	5,170	30.06.2023	03.07.2023	1.800	Ginnie Mae 2,500 % fällig am 20.10.2051	(1.863)	1.800	1.801	15,59
SSB	2,400	30.06.2023	03.07.2023	118	U.S. Treasury Notes 1,875 % fällig am 30.06.2026	(120)	118	118	1,02
Summe Pensionsgeschäfte						**$ (4.128)**	**$ 4.018**	**$ 4.020**	**34,80**

[1] Umfasst aufgelaufene Zinsen.

Aufstellung des Wertpapierbestands des PIMCO StocksPLUS™ AR Fund (Fort.)

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

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

FUTURES

Beschreibung	Art	Ablauf-monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
E-mini S&P 500 Index September Futures	Long	09.2023	5	$ 30	0,26
Euro-Bund 10-Year Bond September Futures	Short	09.2023	1	1	0,01
U.S. Treasury 2-Year Note September Futures	Long	09.2023	7	(15)	(0,13)
U.S. Treasury 5-Year Note September Futures	Short	09.2023	8	17	0,15
U.S. Treasury 10-Year Note September Futures	Long	09.2023	13	(25)	(0,22)
U.S. Treasury 30-Year Bond September Futures	Long	09.2023	1	0	0,00
				$ 8	0,07
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate				**$ 8**	**0,07**

ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)

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

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES - SCHUTZVERKAUF[1]

Index/Tranchen	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag[2]	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
CDX.HY-40 5-Year Index	5,000 %	20.06.2028	$ 200	$ 6	0,05
CDX.IG-40 5-Year Index	1,000	20.06.2028	5.900	33	0,28
				$ 39	0,33

ZINSSWAPS

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	0,407 %	21.07.2024	$ 200	$ (12)	(0,11)
Zahlung[3]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	0,500	16.06.2028	200	(21)	(0,17)
Zahlung[3]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	0,740	15.02.2027	100	(12)	(0,10)
Zahlung[3]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,000	16.12.2025	350	(34)	(0,29)
Erhalt[3]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,000	16.12.2027	300	44	0,38
Erhalt[3]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,250	17.06.2030	100	22	0,19
Erhalt[3]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,250	16.06.2051	100	20	0,18
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,277	21.07.2031	200	38	0,31
Erhalt[3]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,500	18.12.2029	200	21	0,19
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,750	15.06.2024	600	3	0,02
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,750	15.06.2032	700	21	0,18
Erhalt[3]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,500	18.12.2024	100	9	0,08
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,750	21.06.2053	100	3	0,02
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,000	21.06.2030	200	3	0,02
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,000	21.06.2033	400	(16)	(0,13)
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,250	21.06.2028	200	3	0,02
Erhalt[3]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,750	20.12.2028	100	1	0,01
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	0,000	21.07.2023	400	0	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	0,500	16.09.2023	200	(3)	(0,02)
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	0,740	15.08.2023	100	(1)	(0,01)
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,000	16.09.2023	50	(1)	(0,01)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,250	16.09.2023	100	1	0,01
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,250	17.09.2023	100	1	0,01
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,500	18.09.2023	200	2	0,02
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,500	18.09.2023	100	1	0,01
Erhalt[3]	6-Month EUR-EURIBOR	2,500	20.09.2053	€ 90	(2)	(0,02)
Zahlung[3]	6-Month EUR-EURIBOR	3,000	20.09.2033	200	2	0,02
					$ 93	0,81
Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate					**$ 132**	**1,14**

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

(2) Der maximal mögliche Betrag, den der Fonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

(3) Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft.

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

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

TOTAL RETURN SWAPS AUF INDIZES

Kontrahent	Zahlung/Erhalt	Wertpapier	Anzahl der Anteile oder Einheiten	Variabler Zinssatz	Nenn-betrag	Fälligkeits-datum	Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Markt-wert	% des Nettovermögens
BRC	Erhalt	S&P 500 Total Return Index	111	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	$ 995	04.10.2023	$ 0	$ 62	$ 62	0,53
CBK	Erhalt	S&P 500 Total Return Index	170	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	1.524	10.01.2024	0	94	94	0,82
FAR	Erhalt	S&P 500 Total Return Index	155	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	1.390	02.08.2023	0	86	86	0,74
	Erhalt	S&P 500 Total Return Index	85	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	762	27.09.2023	0	47	47	0,41
RBC	Erhalt	S&P 500 Total Return Index	569	1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads	5.102	21.02.2024	0	315	315	2,73
							$ 0	$ 604	$ 604	5,23

DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2023	DKK 141	$ 20	$ 0	$ 0	$ 0	0,00
	07.2023	$ 38	DKK 255	0	0	0	0,00
	08.2023	DKK 255	$ 38	0	0	0	0,00
	08.2023	€ 10	11	0	0	0	0,00
BRC	07.2023	¥ 30.000	232	25	0	25	0,22
	08.2023	£ 3	4	0	0	0	0,00
CBK	08.2023	$ 16	£ 13	0	0	0	0,00
CLY	07.2023	DKK 413	$ 60	0	(2)	(2)	(0,01)
JPM	08.2023	£ 32	40	0	0	0	0,00
MBC	08.2023	€ 1.323	1.460	13	0	13	0,11
MYI	07.2023	$ 33	DKK 227	0	0	0	0,00
	08.2023	DKK 227	$ 33	0	0	0	0,00
RBC	07.2023	$ 0	MXN 0	0	0	0	0,00
	08.2023	£ 6	$ 8	0	0	0	0,00
	08.2023	MXN 0	0	0	0	0	0,00
SSB	07.2023	¥ 30.000	227	19	0	19	0,16
	08.2023	30.000	226	17	0	17	0,15
UAG	08.2023	£ 28	35	0	0	0	0,00
	08.2023	¥ 30.000	221	13	0	13	0,11
	08.2023	$ 6	€ 6	0	0	0	0,00
				$ 87	$ (2)	$ 85	0,74

ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklasse Institutional GBP (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
CBK	07.2023	$ 8	£ 6	$ 0	$ 0	$ 0	0,00
MBC	07.2023	£ 7	$ 9	0	0	0	0,00
	07.2023	$ 305	£ 246	9	0	9	0,07
MYI	07.2023	306	246	7	0	7	0,06
SCX	07.2023	311	249	6	0	6	0,06
				$ 22	$ 0	$ 22	0,19

Summe Freiverkehrsfinanzderivate	**$ 711**	**6,16**

LEERVERKAUFTE WERTPAPIERE

BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
US-REGIERUNGSBEHÖRDEN			
Uniform Mortgage-Backed Security, TBA			
2,500 % fällig am 01.07.2053	$ 400	$ (339)	(2,94)
Summe Leerverkaufte Wertpapiere		**$ (339)**	**(2,94)**
Summe Anlagen		**$ 13.133**	**113,74**
Sonstige Aktiva und Passiva		**$ (1.586)**	**(13,74)**
Nettovermögen		**$ 11.547**	**100,00**

ERLÄUTERUNGEN ZUR AUFSTELLUNG DES WERTPAPIERBESTANDS (Angaben in Tausend*):

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

^ **Das Wertpapier ist in Verzug.**

(a) **Nullkuponwertpapier.**

(b) **Der Kupon stellt eine Rendite bis zur Endfälligkeit dar.**

(c) **Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.**

(d) **Mit dem Fonds verbunden.**

Barmittel in Höhe von 299 USD (31. Dezember 2022: 221 USD) wurden zum 30. Juni 2023 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Barmittel in Höhe von null USD (31. Dezember 2022: 640 USD) wurden zum 30. Juni 2023 gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. als Sicherheit für Finanzderivate verpfändet.

Beizulegender Zeitwert[1]

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 30. Juni 2023 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie[2]	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	$ 0	$ 7.467	$ 19	$ 7.486
Investmentfonds	1.117	0	0	1.117
Pensionsgeschäfte	0	4.018	0	4.018
Finanzderivate[3]	31	820	0	851
Leerverkaufte Wertpapiere	0	(339)	0	(339)
Summen	**$ 1.148**	**$ 11.966**	**$ 19**	**$ 13.133**

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

Kategorie[2]	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	$ 0	$ 7.750	$ 0	$ 7.750
Investmentfonds	528	376	0	904
Pensionsgeschäfte	0	1.374	0	1.374
Finanzderivate[3]	9	(44)	0	(35)
Leerverkaufte Wertpapiere	0	(583)	0	(583)
Summen	**$ 537**	**$ 8.873**	**$ 0**	**$ 9.410**

(1) Weitere Informationen finden Sie in den Erläuterungen in Erläuterung 3.

(2) Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung des Wertpapierbestands.

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

Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC-Finanzderivate und -Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2023 und 31. Dezember 2022:

	Zum 30. Jun. 2023			Zum 31. Dez. 2022		
Kontrahent	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-engagement[1]	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-engagement[1]
BOA	$ k. A.	$ k. A.	$ k. A.	$ (43)	$ 0	$ (43)
BRC	87	(80)	7	(4)	80	76
CBK	94	0	94	7	0	7
CLY	(2)	0	(2)	(1)	0	(1)
DUB	k. A.	k. A.	k. A.	(47)	0	(47)
FAR	133	0	133	(16)	280	264
GLM	k. A.	k. A.	k. A.	(1)	0	(1)
MBC	22	0	22	(19)	0	(19)
MYI	7	0	7	k. A.	k. A.	k. A.
RBC	315	(300)	15	(17)	280	263
RYL	k. A.	k. A.	k. A.	(26)	0	(26)
SCX	6	0	6	3	0	3
SSB	36	0	36	k. A.	k. A.	k. A.
UAG	13	0	13	k. A.	k. A.	k. A.

(1) Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären.

Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung des Wertpapierbestands zum 30. Juni 2023:

	30. Jun. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	22,68	20,10
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	42,16	61,13
Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente	k. A.	0,10
Investmentfonds	9,67	9,49
Pensionsgeschäfte	34,80	14,42
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	0,07	(0,07)
Zentral abgerechnete Finanzderivate	1,14	1,43
Freiverkehrsfinanzderivate	6,16	(1,72)
Leerverkaufte Wertpapiere	(2,94)	(6,12)

Das Anlageportfolio des Fonds konzentriert sich zum 30. Juni 2023 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	30. Jun. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
Unternehmensanleihen und Wechsel	3,56	8,52
US-Regierungsbehörden	15,61	7,38
US-Schatzobligationen	1,66	1,25
Non-Agency-MBS	6,98	9,36
Forderungsbesicherte Wertpapiere	16,88	20,52
Kurzfristige Instrumente	20,15	34,30
Investmentfonds	9,67	9,49
Pensionsgeschäfte	34,80	14,42
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	0,07	(0,07)
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Kreditindizes— Schutzverkauf	0,33	0,46
Zinsswaps	0,81	0,97
Freiverkehrsfinanzderivate		
Total Return Swaps auf Indizes	5,23	(0,39)
Devisenterminkontrakte	0,74	(1,42)
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	0,19	0,09
Leerverkaufte Wertpapiere	(2,94)	(6,12)
Sonstige Aktiva und Passiva	(13,74)	1,24
Nettovermögen	100,00	100,00

Aufstellung des Wertpapierbestands des Strategic Income Fund

BESCHREIBUNG		PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE				
KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG				
Carnival Corp.				
8,217 % fällig am 30.06.2025	$	970	$ 970	0,21
Emerald TopCo, Inc.				
8,584 % fällig am 24.07.2026		40	39	0,01
Envision Healthcare Corp.				
16,070 % fällig am 29.04.2027		762	908	0,20
16,695 % fällig am 28.04.2028 ^		1.906	1.405	0,30
Intelsat Jackson Holdings S.A.				
9,443 % fällig am 01.02.2029		987	984	0,21
Lealand Finance Co. BV				
8,193 % fällig am 28.06.2024		26	21	0,01
Lealand Finance Co. BV (2,666 % bar oder 3,000 % PIK)				
3,000 % - 6,193 % fällig am 30.06.2025 (b)		145	84	0,02
Poseidon BidCo S.A.S				
8,848 % fällig am 14.07.2028	€	1.900	2.032	0,44
PUG LLC				
8,525 % fällig am 12.02.2027	$	45	40	0,01
RegionalCare Hospital Partners Holdings, Inc.				
9,023 % fällig am 16.11.2025		87	80	0,02
SCUR-Alpha 1503 GmbH				
10,602 % fällig am 28.03.2030		998	946	0,21
SS&C European Holdings SARL				
6,967 % fällig am 16.04.2025		55	56	0,01
SS&C Technologies, Inc.				
6,967 % fällig am 16.04.2025		66	66	0,01
Syniverse Holdings, Inc.				
12,242 % fällig am 13.05.2027		100	92	0,02
U.S. Renal Care, Inc.				
10,192 % fällig am 26.06.2026		192	90	0,02
Windstream Services LLC				
11,452 % fällig am 21.09.2027		20	19	0,00
			7.832	1,70
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
BANKEN UND FINANZEN				
Avolon Holdings Funding Ltd.				
2,528 % fällig am 18.11.2027		1.580	1.334	0,29
Banca Monte dei Paschi di Siena SpA				
6,750 % fällig am 02.03.2026	€	700	765	0,17
Banco de Credito del Peru S.A.				
4,650 % fällig am 17.09.2024	PEN	1.100	291	0,06
Banco Espirito Santo S.A.				
2,625 % fällig am 08.05.2017 ^	€	100	27	0,01
Barclays PLC				
7,437 % fällig am 02.11.2033	$	625	677	0,15
Corestate Capital Holding S.A.				
3,500 % fällig am 31.07.2023 ^	€	700	108	0,02
Credit Suisse AG				
6,500 % fällig am 08.08.2023 (h)	$	1.915	1.908	0,41
Credit Suisse AG AT1 Claim ^		600	24	0,01
Deutsche Bank AG				
3,547 % fällig am 18.09.2031		400	332	0,07
6,720 % fällig am 18.01.2029		300	301	0,06
EPR Properties				
4,750 % fällig am 15.12.2026		15	14	0,00
4,950 % fällig am 15.04.2028		24	21	0,00
GLP Capital LP				
5,250 % fällig am 01.06.2025		39	38	0,01
5,300 % fällig am 15.01.2029		186	177	0,04
HSBC Holdings PLC				
3,973 % fällig am 22.05.2030		1.700	1.528	0,33
Morgan Stanley				
0,000 % fällig am 02.04.2032 (j)		700	437	0,09
NatWest Group PLC				
4,445 % fällig am 08.05.2030		1.200	1.104	0,24
4,892 % fällig am 18.05.2029		500	476	0,10
5,076 % fällig am 27.01.2030		1.400	1.337	0,29
Nordea Kredit Realkreditaktieselskab				
2,000 % fällig am 01.10.2047	DKK	0	0	0,00
Nykredit Realkredit A/S				
2,000 % fällig am 01.10.2047		0	0	0,00
Park Aerospace Holdings Ltd.				
5,500 % fällig am 15.02.2024	$	7	$ 7	0,00
Societe Generale S.A.				
6,446 % fällig am 10.01.2029		1.700	1.704	0,37
6,691 % fällig am 10.01.2034		1.800	1.834	0,40
Sunac China Holdings Ltd.				
8,350 % fällig am 19.04.2023 ^		200	30	0,01
UBS Group AG				
3,869 % fällig am 12.01.2029		1.670	1.511	0,33
5,959 % fällig am 12.01.2034		3.458	3.442	0,74
6,373 % fällig am 15.07.2026		250	249	0,05
6,442 % fällig am 11.08.2028		250	251	0,05
6,537 % fällig am 12.08.2033		400	410	0,09
Unique Pub Finance Co. PLC				
5,659 % fällig am 30.06.2027	£	652	813	0,18
Voyager Aviation Holdings LLC				
8,500 % fällig am 09.05.2026	$	33	26	0,01
			21.176	4,58
INDUSTRIEWERTE				
American Airlines Pass-Through Trust				
3,350 % fällig am 15.04.2031		29	26	0,01
Carvana Co.				
5,500 % fällig am 15.04.2027		668	448	0,10
10,250 % fällig am 01.05.2030		2.120	1.673	0,36
Community Health Systems, Inc.				
8,000 % fällig am 15.03.2026		682	665	0,14
Energy Transfer LP				
4,950 % fällig am 15.05.2028		25	24	0,01
Exela Intermediate LLC				
11,500 % fällig am 15.07.2026		57	5	0,00
Gazprom PJSC Via Gaz Capital S.A.				
2,949 % fällig am 24.01.2024	€	500	461	0,10
Intelsat Jackson Holdings S.A.				
6,500 % fällig am 15.03.2030	$	3.988	3.640	0,79
Market Bidco Finco PLC				
4,750 % fällig am 04.11.2027	€	800	705	0,15
Mitchells & Butlers Finance PLC				
6,013 % fällig am 15.12.2030	£	24	28	0,01
NMG Holding Co., Inc.				
7,125 % fällig am 01.04.2026	$	700	652	0,14
Petroleos de Venezuela S.A.				
5,375 % fällig am 12.04.2027 ^		707	25	0,01
5,500 % fällig am 12.04.2037 ^		762	30	0,01
6,000 % fällig am 16.05.2024 ^		642	25	0,01
6,000 % fällig am 15.11.2026 ^		518	18	0,00
9,750 % fällig am 17.05.2035 ^		280	11	0,00
Petroleos Mexicanos				
6,700 % fällig am 16.02.2032		2.084	1.586	0,34
Roadster Finance DAC				
2,375 % fällig am 08.12.2032	€	100	90	0,02
Topaz Solar Farms LLC				
4,875 % fällig am 30.09.2039	$	69	64	0,01
5,750 % fällig am 30.09.2039		596	586	0,13
U.S. Renal Care, Inc.				
10,625 % fällig am 15.07.2027		90	23	0,00
United Airlines Pass-Through Trust				
4,150 % fällig am 11.10.2025		7	7	0,00
5,875 % fällig am 15.04.2029		5.047	5.009	1,08
Valaris Ltd.				
8,375 % fällig am 30.04.2030		11	11	0,00
Venture Global LNG, Inc.				
8,125 % fällig am 01.06.2028		842	856	0,19
8,375 % fällig am 01.06.2031		842	850	0,18
Windstream Escrow LLC				
7,750 % fällig am 15.08.2028		1.753	1.457	0,32
			18.975	4,11
VERSORGUNGSUNTERNEHMEN				
Gazprom PJSC Via Gaz Finance PLC				
2,950 % fällig am 27.01.2029		5.100	3.188	0,69
Pacific Gas & Electric Co.				
2,950 % fällig am 01.03.2026 ^		1.154	1.058	0,23
3,250 % fällig am 01.06.2031		2.460	2.002	0,43
3,300 % fällig am 15.03.2027 ^		324	294	0,06
3,400 % fällig am 15.08.2024 ^		403	390	0,09
3,750 % fällig am 01.07.2028	$	1.102	$ 988	0,21
3,750 % fällig am 15.08.2042 ^		20	14	0,00
4,000 % fällig am 01.12.2046 ^		8	5	0,00
4,200 % fällig am 01.03.2029		1.000	900	0,20
4,250 % fällig am 15.03.2046 ^		6	4	0,00
4,300 % fällig am 15.03.2045 ^		236	169	0,04
4,450 % fällig am 15.04.2042 ^		145	110	0,02
4,500 % fällig am 15.12.2041 ^		30	22	0,01
4,950 % fällig am 01.07.2050		2.011	1.582	0,34
Rio Oil Finance Trust				
8,200 % fällig am 06.04.2028		202	203	0,05
Sprint LLC				
7,625 % fällig am 01.03.2026		47	49	0,01
7,875 % fällig am 15.09.2023		2.549	2.557	0,55
			13.535	2,93
Summe Unternehmensanleihen und Wechsel			53.686	11,62
KOMMUNALANLEIHEN UND WECHSEL				
Commonwealth of Puerto Rico General Obligation Bonds, Series 2022				
0,000 % fällig am 01.11.2043		457	231	0,05
Illinois State General Obligation Bonds, (BABs), Series 2010				
6,630 % fällig am 01.02.2035		28	29	0,01
7,350 % fällig am 01.07.2035		14	15	0,00
Puerto Rico Electric Power Authority Revenue Bonds, (BABs), Series 2010				
6,125 % fällig am 01.07.2040 ^		200	75	0,02
			350	0,08
US-REGIERUNGSBEHÖRDEN				
Fannie Mae				
0,850 % fällig am 25.11.2049 (a)		109	14	0,00
2,500 % fällig am 25.07.2033 (a)		42	4	0,00
Freddie Mac				
1,357 % fällig am 15.06.2042 (a)		40	4	0,00
Ginnie Mae, TBA				
3,500 % fällig am 01.08.2053		3.600	3.327	0,72
4,000 % fällig am 01.08.2053		2.300	2.178	0,47
4,500 % fällig am 01.08.2053		13.500	13.037	2,82
5,000 % fällig am 01.07.2053		800	786	0,17
Uniform Mortgage-Backed Security				
3,000 % fällig am 01.03.2050 - 01.05.2052		1.437	1.269	0,28
3,500 % fällig am 01.04.2048 - 01.02.2050		522	482	0,10
4,000 % fällig am 01.08.2039 - 01.05.2047		1.218	1.162	0,25
Uniform Mortgage-Backed Security, TBA				
3,000 % fällig am 01.07.2038 - 01.08.2053		22.400	19.900	4,31
3,500 % fällig am 01.08.2053		28.450	25.955	5,62
4,000 % fällig am 01.08.2053		37.200	34.943	7,58
4,500 % fällig am 01.08.2053		18.400	17.700	3,83
5,000 % fällig am 01.09.2053		7.300	7.158	1,55
5,500 % fällig am 01.07.2053		20.900	20.798	4,50
6,000 % fällig am 01.08.2053		25.400	25.620	5,55
6,500 % fällig am 01.08.2053		8.200	8.368	1,81
			182.705	39,56
US-SCHATZOBLIGATIONEN				
U.S. Treasury Bonds				
2,875 % fällig am 15.11.2046		2.200	1.814	0,39
3,000 % fällig am 15.11.2045		4.800	4.051	0,88
3,000 % fällig am 15.08.2048		20	17	0,00
3,000 % fällig am 15.02.2049		3.500	2.962	0,64
3,125 % fällig am 15.02.2043		114	100	0,02
3,375 % fällig am 15.05.2044		20	18	0,00
3,625 % fällig am 15.08.2043		372	349	0,08
3,625 % fällig am 15.02.2044		280	263	0,06
3,750 % fällig am 15.11.2043		160	153	0,03
U.S. Treasury Inflation Protected Securities (f)				
0,125 % fällig am 15.07.2024		4.496	4.362	0,94
0,125 % fällig am 15.10.2024		3.618	3.490	0,76
0,125 % fällig am 15.04.2025		88	84	0,02
0,125 % fällig am 15.01.2031		117	104	0,02
0,125 % fällig am 15.07.2031		113	100	0,02
0,250 % fällig am 15.01.2025		1.056	1.013	0,22

BESCHREIBUNG		PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
0,250 % fällig am 15.02.2050	$	1.180	$ 826	0,18
0,375 % fällig am 15.07.2023		3.793	3.790	0,82
0,500 % fällig am 15.04.2024		3.427	3.345	0,72
0,625 % fällig am 15.01.2024		5.824	5.725	1,24
0,625 % fällig am 15.07.2032		3.132	2.880	0,62
0,750 % fällig am 15.02.2042		134	114	0,02
0,750 % fällig am 15.02.2045		1.030	853	0,19
0,875 % fällig am 15.02.2047		1.257	1.055	0,23
1,000 % fällig am 15.02.2046		512	445	0,10
1,000 % fällig am 15.02.2048		1.599	1.377	0,30
1,000 % fällig am 15.02.2049		3.869	3.331	0,72
1,375 % fällig am 15.02.2044		130	123	0,03
2,125 % fällig am 15.02.2041		139	149	0,03
U.S. Treasury Notes				
0,375 % fällig am 30.09.2027		110	94	0,02
0,500 % fällig am 31.10.2027		200	171	0,04
0,625 % fällig am 30.11.2027		1.860	1.593	0,34
0,625 % fällig am 31.12.2027		760	650	0,14
0,750 % fällig am 31.01.2028		640	549	0,12
1,250 % fällig am 30.06.2028		14.000	12.190	2,64
1,500 % fällig am 15.08.2026		200	183	0,04
2,250 % fällig am 15.11.2025		1.030	973	0,21
2,375 % fällig am 31.03.2029		3.200	2.922	0,63
2,625 % fällig am 31.01.2026		9.200	8.757	1,90
2,625 % fällig am 15.02.2029		160	148	0,03
2,750 % fällig am 15.02.2028		600	564	0,12
2,875 % fällig am 15.08.2028		120	113	0,02
2,875 % fällig am 30.04.2029		8.700	8.160	1,77
2,875 % fällig am 15.05.2032		630	584	0,13
4,000 % fällig am 31.10.2029		3.600	3.592	0,78
			84.136	18,21

NON-AGENCY-MBS

BESCHREIBUNG		PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
American Home Mortgage Assets Trust				
4,896 % fällig am 25.11.2046		4.431	1.367	0,30
Banc of America Funding Corp.				
4,401 % fällig am 25.09.2048		1.734	1.611	0,35
Banc of America Funding Trust				
3,383 % fällig am 20.05.2036 ^		36	28	0,01
Bear Stearns Mortgage Funding Trust				
5,590 % fällig am 25.08.2036		899	796	0,17
CitiMortgage Alternative Loan Trust				
6,000 % fällig am 25.12.2036 ^		194	161	0,04
Countrywide Alternative Loan Trust				
5,430 % fällig am 25.06.2037		1.702	1.532	0,33
5,500 % fällig am 25.09.2035 ^		1.989	1.483	0,32
6,000 % fällig am 25.10.2035 ^		320	223	0,05
Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust				
5,810 % fällig am 25.02.2035		597	480	0,10
Countrywide Home Loan Reperforming REMIC Trust				
6,500 % fällig am 25.11.2034 ^		203	185	0,04
Eurosail PLC				
5,690 % fällig am 13.09.2045	£	2.771	3.485	0,75
5,940 % fällig am 13.06.2045		1.054	1.325	0,29
GreenPoint Mortgage Funding Trust				
5,550 % fällig am 25.10.2046	$	375	344	0,08
Grifonas Finance PLC				
3,513 % fällig am 28.08.2039	€	196	204	0,04
GSMPS Mortgage Loan Trust				
7,059 % fällig am 20.10.2032	$	1.382	1.204	0,26
GSMSC Resecuritization Trust				
3,126 % fällig am 26.04.2037		7.355	2.043	0,44
HomeBanc Mortgage Trust				
3,864 % fällig am 25.04.2037		17	16	0,00
JPMorgan Mortgage Trust				
4,218 % fällig am 25.01.2037 ^		79	67	0,01
4,281 % fällig am 25.08.2036 ^		33	27	0,01
Legacy Mortgage Asset Trust				
6,928 % fällig am 28.01.2070		1.161	1.162	0,25
MASTR Adjustable Rate Mortgages Trust				
6,250 % fällig am 25.09.2037		7.300	3.172	0,69
Morgan Stanley Capital Trust				
7,143 % fällig am 15.07.2035		3.026	2.956	0,64
Morgan Stanley Mortgage Loan Trust				
5,410 % fällig am 25.04.2035		52	48	0,01
RBSGC Mortgage Loan Trust				
6,000 % fällig am 25.01.2037 ^		18	14	0,00
Sandwell Commercial Finance PLC				
5,940 % fällig am 30.09.2037	£	22	$ 13	0,00
Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust				
3,665 % fällig am 25.09.2035	$	54	39	0,01
5,376 % fällig am 25.05.2035 ^		120	94	0,02
WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust				
4,008 % fällig am 25.12.2046 ^		2.007	1.720	0,37
5,024 % fällig am 25.08.2046		834	687	0,15
Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates Trust				
5,500 % fällig am 25.05.2035 ^		281	222	0,05
Wells Fargo Alternative Loan Trust				
6,250 % fällig am 25.07.2037 ^		913	774	0,17
Wells Fargo Mortgage-Backed Securities Trust				
4,509 % fällig am 25.10.2036 ^		12	10	0,00
			27.492	5,95

FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE

BESCHREIBUNG		PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
ACE Securities Corp. Home Equity Loan Trust				
5,630 % fällig am 25.04.2036		6.616	6.035	1,31
Aegis Asset-Backed Securities Trust				
6,150 % fällig am 25.03.2035 ^		511	475	0,10
Ameriquest Mortgage Securities Trust				
5,660 % fällig am 25.04.2036		525	519	0,11
Ameriquest Mortgage Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates				
6,125 % fällig am 25.07.2035		3.990	3.671	0,79
6,125 % fällig am 25.09.2035		1.635	1.312	0,28
Argent Securities Trust				
5,450 % fällig am 25.07.2036		5.127	4.372	0,95
Asset-Backed Funding Certificates Trust				
5,975 % fällig am 25.08.2033		6	5	0,00
Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust				
7,100 % fällig am 25.11.2039		315	317	0,07
Castlelake Aircraft Securitization Trust				
4,125 % fällig am 15.06.2043		504	455	0,10
Countrywide Asset-Backed Certificates Trust				
5,400 % fällig am 25.11.2047 ^		5.064	4.416	0,96
5,410 % fällig am 25.12.2036 ^		1.957	1.754	0,38
6,215 % fällig am 25.08.2035		1.323	1.318	0,29
Credit-Based Asset Servicing & Securitization Trust				
3,156 % fällig am 25.01.2037 ^		169	53	0,01
Fieldstone Mortgage Investment Trust				
5,378 % fällig am 25.11.2036		1.780	1.036	0,22
First Franklin Mortgage Loan Trust				
5,270 % fällig am 25.12.2036		4.281	4.004	0,87
Fremont Home Loan Trust				
5,300 % fällig am 25.01.2037		1.460	675	0,15
GSAMP Trust				
5,520 % fällig am 25.03.2047		9.000	6.751	1,46
Harley Marine Financing LLC				
6,682 % fällig am 15.05.2043		84	78	0,02
Home Equity Mortgage Loan Asset-Backed Trust				
5,270 % fällig am 25.04.2037		1.806	1.248	0,27
5,310 % fällig am 25.11.2036		3.441	2.929	0,63
5,320 % fällig am 25.04.2037		1.870	1.292	0,28
HSI Asset Securitization Corp. Trust				
5,290 % fällig am 25.01.2037		4.931	3.701	0,80
Long Beach Mortgage Loan Trust				
5,510 % fällig am 25.03.2046		3.149	2.582	0,56
5,750 % fällig am 25.01.2036		2.671	2.401	0,52
Madison Avenue Manufactured Housing Contract Trust				
8,400 % fällig am 25.03.2032		365	366	0,08
MASTR Asset-Backed Securities Trust				
5,670 % fällig am 25.06.2036		1.479	1.301	0,28
Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust				
3,580 % fällig am 25.01.2035		975	844	0,18
5,260 % fällig am 25.02.2037		717	346	0,08
5,300 % fällig am 25.02.2037		2.223	1.074	0,23
5,400 % fällig am 25.03.2037		8.113	3.584	0,78
New Century Home Equity Loan Trust				
5,930 % fällig am 25.03.2035		72	67	0,01
7,175 % fällig am 25.05.2034 ^		64	68	0,01
Park Place Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates				
6,470 % fällig am 25.01.2036 ^		5.365	4.882	1,06
Renaissance Home Equity Loan Trust				
5,434 % fällig am 25.08.2035	$	23	$ 22	0,01
Saxon Asset Securities Trust				
6,900 % fällig am 25.12.2037		1.725	1.575	0,34
Soundview Home Loan Trust				
5,615 % fällig am 25.06.2036 ^		7.554	6.207	1,34
6,150 % fällig am 25.09.2037		5.764	3.917	0,85
6,185 % fällig am 25.05.2035		1.087	1.067	0,23
Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust				
5,490 % fällig am 25.12.2036		111	108	0,02
5,650 % fällig am 25.11.2037		2.600	2.288	0,50
6,275 % fällig am 25.07.2035		1.220	1.175	0,25
TruPS Financials Note Securitization Ltd.				
7,080 % fällig am 20.09.2039		1.463	1.397	0,30
Wells Fargo Home Equity Asset-Backed Securities Trust				
5,570 % fällig am 25.03.2037		7	7	0,00
			81.694	17,68

STAATSEMISSIONEN

BESCHREIBUNG		PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
Argentina Government International Bond				
0,500 % fällig am 09.07.2030		5.595	1.749	0,38
1,000 % fällig am 09.07.2029		377	123	0,03
1,500 % fällig am 09.07.2035		2.879	842	0,18
1,500 % fällig am 09.07.2046		115	35	0,01
15,500 % fällig am 17.10.2026	ARS	3.906	2	0,00
Australia Government International Bond				
1,750 % fällig am 21.06.2051	AUD	2.200	853	0,18
Autonome Stadt Buenos Aires				
95,645 % fällig am 22.02.2028 (a)	ARS	27.495	53	0,01
Export-Credit Bank of Turkey				
8,250 % fällig am 24.01.2024	$	200	200	0,04
Israel Government International Bond				
3,800 % fällig am 13.05.2060		2.400	1.828	0,40
Peru Government International Bond				
5,400 % fällig am 12.08.2034	PEN	83	20	0,00
6,150 % fällig am 12.08.2032		200	53	0,01
6,950 % fällig am 12.08.2031		2	1	0,00
Provincia de Buenos Aires				
88,734 % fällig am 12.04.2025 (a)	ARS	14.289	26	0,01
Republic of Greece Government International Bond				
3,750 % fällig am 30.01.2028	€	58	64	0,01
3,900 % fällig am 30.01.2033		61	69	0,01
4,000 % fällig am 30.01.2037		36	40	0,01
4,200 % fällig am 30.01.2042		11	13	0,00
Russia Government International Bond				
4,250 % fällig am 23.06.2027 ^	$	800	348	0,08
4,750 % fällig am 27.05.2026 ^		1.200	606	0,13
5,100 % fällig am 28.03.2035 ^		200	89	0,02
5,250 % fällig am 23.06.2047 ^		400	178	0,04
5,250 % fällig am 23.06.2047 ^		3.800	228	0,05
5,625 % fällig am 04.04.2042 ^		1.800	1.228	0,27
5,875 % fällig am 16.09.2043 ^		200	126	0,03
7,150 % fällig am 12.11.2025 ^	RUB	214.863	1.257	0,27
7,500 % fällig am 31.03.2030 ^	$	202	133	0,03
7,950 % fällig am 07.10.2026 ^	RUB	82.843	485	0,11
12,750 % fällig am 24.06.2028 ^	$	185	183	0,04
South Africa Government International Bond				
10,500 % fällig am 21.12.2026	ZAR	97.100	5.338	1,16
Venezuela Government International Bond				
6,000 % fällig am 09.12.2020 ^	$	289	18	0,00
7,000 % fällig am 31.03.2038 ^		107	9	0,00
7,650 % fällig am 21.04.2025 ^		266	23	0,00
8,250 % fällig am 13.10.2024 ^		269	25	0,01
9,000 % fällig am 07.05.2023 ^		144	13	0,00
9,250 % fällig am 15.09.2027 ^		301	27	0,01
9,250 % fällig am 07.05.2028 ^		256	23	0,00
11,750 % fällig am 21.10.2026 ^		40	4	0,00
11,950 % fällig am 05.08.2031 ^		400	37	0,01
12,750 % fällig am 23.08.2022 ^		180	16	0,00
			16.365	3,54

	AKTIEN		
STAMMAKTIEN			
KOMMUNIKATIONSDIENSTE			
AT&T, Inc. (c)	9.902	158	0,03

BESCHREIBUNG	AKTIEN	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
Clear Channel Outdoor Holdings, Inc. (c)	320.208	$ 439	0,10
Electronic Arts, Inc.	116	15	0,00
iHeartMedia, Inc. 'A' (c)	75.157	274	0,06
iHeartMedia, Inc. 'B' (c)	58.371	191	0,04
Intelsat Emergence S.A. (c)(j)	54.795	1.260	0,27
Nintendo Co. Ltd. (c)	19.700	897	0,20
Orange S.A. (c)	13.263	155	0,03
Telkom Indonesia Persero Tbk PT	1.657.600	443	0,10
Verizon Communications, Inc. (c)	21.266	791	0,17
		4.623	1,00
LUXUSGÜTER			
Best Buy Co., Inc.	2.137	175	0,04
Darden Restaurants, Inc. (c)	4.284	716	0,16
eBay, Inc.	3.869	173	0,04
Garmin Ltd. (c)	4.118	429	0,09
Genting Singapore Ltd.	213.800	149	0,03
Genuine Parts Co.	972	165	0,04
Honda Motor Co. Ltd. (c)	17.200	520	0,11
Industria de Diseno Textil S.A. (c)	38.650	1.499	0,32
Kia Corp.	9.351	630	0,14
LKQ Corp.	9.357	545	0,12
Mazda Motor Corp. (c)	19.100	184	0,04
Mercedes-Benz Group AG	3.378	272	0,06
Stellantis NV	79.702	1.401	0,30
		6.858	1,49
BASISKONSUMGÜTER			
Altria Group, Inc.	63.281	2.867	0,62
Ambev S.A.	167.500	535	0,12
Arca Continental S.A.B. de C.V.	18.500	190	0,04
British American Tobacco PLC (c)	4.804	160	0,03
Coca-Cola Co.	56.276	3.389	0,73
Coca-Cola HBC AG	5.493	164	0,03
Coles Group Ltd.	14.436	177	0,04
Japan Tobacco, Inc. (c)	39.300	859	0,19
Jeronimo Martins SGPS S.A.	9.748	268	0,06
Kao Corp. (c)	4.300	156	0,03
Kimberly-Clark Corp.	11.956	1.651	0,36
Neiman Marcus Group Ltd. LLC (c)(j)	8.644	1.313	0,28
Philip Morris International, Inc.	11.016	1.075	0,23
President Chain Store Corp. (c)	20.000	182	0,04
Procter & Gamble Co.	17.237	2.616	0,57
Suntory Beverage & Food Ltd. (c)	4.600	166	0,04
Unilever PLC	30.120	1.570	0,34
		17.338	3,75
ENERGIE			
China Shenhua Energy Co. Ltd. 'H'	119.500	366	0,08
Equinor ASA (c)	22.880	668	0,15
Exxon Mobil Corp.	4.302	461	0,10
HF Sinclair Corp.	5.377	240	0,05
Marathon Petroleum Corp.	15.139	1.765	0,38
Petroleo Brasileiro S.A.	131.900	905	0,20
Valero Energy Corp.	13.032	1.529	0,33
		5.934	1,29
FINANZWERTE			
3i Group PLC	34.465	855	0,18
Absa Group Ltd.	30.054	$ 267	0,06
Aflac, Inc.	20.589	1.437	0,31
Ageas S.A.	4.843	196	0,04
American Financial Group, Inc.	2.565	305	0,07
American International Group, Inc.	25.993	1.496	0,32
Ameriprise Financial, Inc.	3.708	1.232	0,27
Assicurazioni Generali SpA	35.912	730	0,16
AXA S.A.	65.003	1.921	0,42
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A.	213.660	1.641	0,35
Banco de Chile	1.611.550	168	0,04
Banco do Brasil S.A.	29.800	305	0,07
Bank Mandiri Persero Tbk PT	1.306.400	455	0,10
Cairo Mezz PLC (c)	59.349	8	0,00
China Construction Bank Corp. 'H' (c)	3.407.000	2.206	0,48
China Pacific Insurance Group Co. Ltd. 'H'	93.400	243	0,05
Erste Group Bank AG	12.183	427	0,09
Eurobank Ergasias Services and Holdings S.A. 'A' (c)	563.329	928	0,20
FirstRand Ltd.	178.976	650	0,14
Hartford Financial Services Group, Inc.	11.068	797	0,17
KeyCorp.	32.767	303	0,07
Legal & General Group PLC	141.183	409	0,09
Manulife Financial Corp.	25.880	490	0,11
Mediobanca Banca di Credito Finanziario SpA	19.559	234	0,05
Nedbank Group Ltd.	15.397	186	0,04
PICC Property & Casualty Co. Ltd. 'H'	240.000	267	0,06
PNC Financial Services Group, Inc.	1.137	143	0,03
Poste Italiane SpA (c)	17.544	190	0,04
Powszechny Zaklad Ubezpieczen S.A. (c)	21.425	208	0,04
Principal Financial Group, Inc.	8.608	653	0,14
Samsung Fire & Marine Insurance Co. Ltd.	1.057	184	0,04
SpareBank 1 SR-Bank ASA	1.345	16	0,00
State Street Corp.	2.463	180	0,04
Stearns Holdings LLC 'B' (c)	147.250	0	0,00
Synchrony Financial	15.179	515	0,11
Voyager Aviation Holdings LLC (c)	16	0	0,00
		20.245	4,38
GESUNDHEITSWESEN			
AbbVie, Inc. (c)	16.632	2.241	0,49
Amgen, Inc.	9.218	2.047	0,44
Astellas Pharma, Inc. (c)	23.900	355	0,08
Chugai Pharmaceutical Co. Ltd. (c)	23.000	654	0,14
Gilead Sciences, Inc.	11.997	925	0,20
GSK PLC	46.697	828	0,18
Johnson & Johnson	25.471	4.216	0,91
Merck & Co., Inc.	14.277	1.647	0,36
Novartis AG	28.617	2.886	0,62
Pfizer, Inc. (c)	67.437	2.474	0,54
Roche Holding AG	8.659	2.646	0,57
		20.919	4,53
INDUSTRIEWERTE			
3M Co.	17.985	1.800	0,39
AP Moller - Maersk A/S 'A'	109	190	0,04
Astra International Tbk PT	724.300	329	0,07
BAE Systems PLC	108.125	1.276	0,28
Caterpillar, Inc. (c)	793	$ 195	0,04
CITIC Ltd.	206.000	247	0,05
Eiffage S.A.	2.604	272	0,06
Fuji Electric Co. Ltd. (c)	4.400	193	0,04
GEA Group AG	5.191	217	0,05
General Dynamics Corp. (c)	775	167	0,04
ITOCHU Corp. (c)	22.600	896	0,19
Mitsubishi Corp. (c)	16.800	811	0,18
Mitsubishi Heavy Industries Ltd. (c)	4.900	228	0,05
Mitsui & Co. Ltd. (c)	15.900	601	0,13
PACCAR, Inc.	18.514	1.549	0,33
Siemens AG	1.161	193	0,04
SKF AB 'B'	9.354	163	0,03
Thales S.A.	3.724	558	0,12
United Rentals, Inc.	402	179	0,04
Vinci S.A.	7.520	874	0,19
Volvo AB 'B'	14.608	302	0,07
		11.240	2,43
INFORMATIONSTECHNOLOGIE			
Apple, Inc.	5.777	1.121	0,24
ASE Technology Holding Co. Ltd.	108.000	384	0,08
Broadcom, Inc.	4.263	3.698	0,80
Cisco Systems, Inc. (c)	72.742	3.764	0,82
Largan Precision Co. Ltd.	3.000	206	0,05
Lenovo Group Ltd. (c)	258.000	270	0,06
Lite-On Technology Corp.	70.000	233	0,05
MediaTek, Inc.	54.000	1.195	0,26
Microchip Technology, Inc.	8.832	791	0,17
Microsoft Corp. (c)	54	18	0,00
NetApp, Inc. (c)	3.589	274	0,06
Novatek Microelectronics Corp. (c)	20.000	275	0,06
NXP Semiconductors NV	2.973	609	0,13
Realtek Semiconductor Corp. (c)	16.000	199	0,04
Tokyo Electron Ltd. (c)	1.200	173	0,04
Unimicron Technology Corp. (c)	28.000	159	0,03
United Microelectronics Corp.	398.000	625	0,14
		13.994	3,03
BAUSTOFFE			
BHP Group Ltd.	116.278	3.493	0,76
CRH PLC	22.805	1.258	0,27
Evraz PLC	72.869	0	0,00
Fortescue Metals Group Ltd.	60.077	891	0,19
Grupo Mexico S.A.B. de C.V. 'B'	37.400	180	0,04
Heidelberg Materials AG	5.131	422	0,09
Holcim AG	19.643	1.324	0,29
Impala Platinum Holdings Ltd.	16.830	112	0,02
LyondellBasell Industries NV 'A'	1.863	171	0,04
Rio Tinto Ltd.	10.965	839	0,18
Rio Tinto PLC	18.252	1.161	0,25
Sibanye Stillwater Ltd.	100.347	154	0,03
Vale S.A.	50.400	671	0,15
Yara International ASA	4.157	147	0,03
		10.823	2,34
VERSORGUNGSUNTERNEHMEN			
Enagas S.A. (c)	8.800	173	0,04
Enel SpA (c)	118.558	799	0,17
Engie S.A.	25.075	418	0,09
Iberdrola S.A. (c)	13.187	172	0,04
Redeia Corp. S.A.	14.011	236	0,05
Snam SpA	71.450	373	0,08

BESCHREIBUNG	AKTIEN	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
Terna Rete Elettrica Nazionale SpA (c)	19.286	$ 164	0,04
		2.335	0,51
		114.309	24,75
RECHTE			
Intelsat Jackson Holdings S.A. - Exp. 05.12.2025	11.842	71	0,01
OPTIONSSCHEINE			
Guaranteed Rate, Inc. - Exp. 31.12.2060	706	0	0,00
Intelsat Emergence S.A. - Exp. 17.02.2027	1.128	2	0,00
Windstream Holdings II, LLC - Exp. 21.09.2055	2.586	39	0,01
		41	0,01
VORZUGSWERTPAPIERE			
Bayerische Motoren Werke AG 0,000 %	2.105	240	0,05
Nationwide Building Society 10,250 %	6.220	911	0,20
Petroleo Brasileiro S.A. 0,000 %	168.800	1.033	0,22
Sociedad Quimica y Minera de Chile S.A. 0,000 %	5.036	367	0,08

BESCHREIBUNG	AKTIEN	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
Voyager Aviation Holdings LLC 9,500 %	93	$ 22	0,01
		2.573	0,56
REAL ESTATE INVESTMENT TRUSTS			
Apartment Income REIT Corp.	34.879	1.259	0,27
Apple Hospitality REIT, Inc.	90.002	1.360	0,29
Boston Properties, Inc.	16.967	977	0,21
CareTrust REIT, Inc.	29.200	580	0,13
CBL & Associates Properties, Inc.	378	8	0,00
Cousins Properties, Inc.	26.939	614	0,13
Digital Realty Trust, Inc.	12.073	1.375	0,30
EPR Properties	25.499	1.193	0,26
Equity Residential	10.526	694	0,15
Gaming and Leisure Properties, Inc.	37.448	1.815	0,39
Healthcare Realty Trust, Inc.	58.968	1.112	0,24
Healthpeak Properties, Inc.	44.877	902	0,20
Highwoods Properties, Inc.	30.875	738	0,16
Kilroy Realty Corp.	23.258	700	0,15
Macerich Co.	51.482	580	0,13
National Storage Affiliates Trust	35.455	1.235	0,27
Park Hotels & Resorts, Inc.	100.691	1.291	0,28
Physicians Realty Trust	32.220	451	0,10
Simon Property Group, Inc.	17.922	2.070	0,45
Spirit Realty Capital, Inc.	26.095	1.028	0,22

BESCHREIBUNG	AKTIEN	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
Uniti Group, Inc.	1.773	$ 8	0,00
VICI Properties, Inc.	127.561	4.009	0,87
WP Carey, Inc.	16.419	1.109	0,24
		25.108	5,44

		PAR (000S)		
KURZFRISTIGE INSTRUMENTE				
ARGENTINA TREASURY BILLS				
(54,758) % fällig am 18.09.2023 (d)(e)	ARS	12.728	25	0,01
(28,578) % fällig am 18.10.2023 (d)(e)		160.664	318	0,07
(12,549) % fällig am 23.11.2023 (d)(e)		150.893	304	0,06
			647	0,14
Summe kurzfristige Instrumente			647	0,14
Summe Übertragbare Wertpapiere			**$ 597.009**	**129,25**

	AKTIEN		
INVESTMENTFONDS			
ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN			
PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (g)	2.337.401	23.276	5,04
Summe Investmentfonds		**$ 23.276**	**5,04**

PENSIONSGESCHÄFTE

Kontrahent	Kredit-zins	Abrechnungs-datum	Fälligkeits-datum	Kapital-betrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensions-geschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensions-geschäft[1]	% des Nettovermögens
FICC	2,400 %	30.06.2023	03.07.2023	$ 2.001	U.S. Treasury Notes 4,625 % fällig am 30.06.2025	$ (2.041)	$ 2.001	$ 2.001	0,43
Summe Pensionsgeschäfte						**$ (2.041)**	**$ 2.001**	**$ 2.001**	**0,43**

[1] Umfasst aufgelaufene Zinsen.

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

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

FUTURES

Beschreibung	Art	Ablauf-monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
3-Month SOFR December Futures	Short	03.2024	15	$ 100	0,02
3-Month SOFR December Futures	Short	03.2025	7	31	0,01
3-Month SOFR December Futures	Short	03.2026	8	26	0,01
3-Month SOFR June Futures	Short	09.2024	10	58	0,01
3-Month SOFR June Futures	Short	09.2025	9	33	0,01
3-Month SOFR March Futures	Short	06.2024	13	83	0,02
3-Month SOFR March Futures	Short	06.2025	7	28	0,01
3-Month SOFR March Futures	Short	06.2026	9	27	0,01
3-Month SOFR September Futures	Short	12.2024	10	51	0,01
3-Month SOFR September Futures	Short	12.2025	6	21	0,00
Australia Government 10-Year Bond September Futures	Short	09.2023	103	43	0,01
Euro-Bund 10-Year Bond September Futures	Short	09.2023	42	58	0,01
U.S. Treasury 5-Year Note September Futures	Long	09.2023	12	(26)	(0,01)
U.S. Treasury 10-Year Note September Futures	Long	09.2023	412	(712)	(0,16)
U.S. Treasury 10-Year Ultra September Futures	Long	09.2023	11	(13)	0,00
U.S. Treasury 30-Year Bond September Futures	Short	09.2023	154	6	0,00
U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond September Futures	Short	09.2023	126	(247)	(0,05)
				$ (433)	(0,09)

VERKAUFSOPTIONEN

OPTIONEN AUF BÖRSENGEHANDELTE TERMINKONTRAKTE

Beschreibung	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Anzahl der Kontrakte	Aufgeld	Markt-wert	% des Nettovermögens
Put - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note August Futures	$ 111,500	21.07.2023	6	$ (3)	$ (2)	0,00
Call - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note August Futures	115,500	21.07.2023	6	(2)	0	0,00
Put - CBOT U.S. Treasury 30-Year Bond August Futures	123,000	21.07.2023	2	(1)	0	0,00

Aufstellung des Wertpapierbestands des Strategic Income Fund (Fort.)

Beschreibung	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Anzahl der Kontrakte	Aufgeld	Markt-wert	% des Nettovermögens
Call - CBOT U.S. Treasury 30-Year Bond August Futures	$ 131,000	21.07.2023	2	$ (1)	$ 0	0,00
Call - CME-Kaufoptionen mit Ausübungskurs bei 96,000 USD auf 3-Month SOFR September Futures	96,000	15.09.2023	8	(13)	(1)	0,00
Call - CME-Kaufoptionen mit Ausübungskurs bei 96,063 USD auf 3-Month SOFR December Futures	96,063	15.12.2023	9	(18)	(2)	0,00
Call - CME-Kaufoptionen mit Ausübungskurs bei 96,125 USD auf 3-Month SOFR December Futures	96,125	15.12.2023	8	(15)	(2)	0,00
Call - CME-Kaufoptionen mit Ausübungskurs bei 96,188 USD auf 3-Month SOFR September Futures	96,188	15.09.2023	13	(25)	(1)	0,00
Call - CME-Kaufoptionen mit Ausübungskurs bei 96,375 USD auf 3-Month SOFR December Futures	96,375	15.12.2023	13	(27)	(2)	0,00
Call - CME-Kaufoptionen mit Ausübungskurs bei 98,000 USD auf 3-Month SOFR December Futures	98,000	15.12.2023	8	(7)	0	0,00
Put - CME-Verkaufsoptionen mit Ausübungskurs bei 96,000 USD auf 3-Month SOFR September Futures	96,000	15.09.2023	8	(15)	(28)	(0,01)
Put - CME-Verkaufsoptionen mit Ausübungskurs bei 96,063 USD auf 3-Month SOFR December Futures	96,063	15.12.2023	9	(18)	(33)	(0,01)
Put - CME-Verkaufsoptionen mit Ausübungskurs bei 96,125 USD auf 3-Month SOFR December Futures	96,125	15.12.2023	8	(15)	(31)	(0,01)
Put - CME-Verkaufsoptionen mit Ausübungskurs bei 96,188 USD auf 3-Month SOFR September Futures	96,188	15.09.2023	13	(26)	(52)	(0,01)
Put - CME-Verkaufsoptionen mit Ausübungskurs bei 96,375 USD auf 3-Month SOFR December Futures	96,375	15.12.2023	13	(28)	(57)	(0,01)
Put - CME-Verkaufsoptionen mit Ausübungskurs bei 96,500 USD auf 3-Month SOFR December Futures	96,500	15.12.2023	8	(7)	(38)	(0,01)
				$ (221)	$ (249)	(0,06)
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate					**$ (682)**	**(0,15)**

ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)

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

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMMISSIONEN - SCHUTZVERKAUF[1]

Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag[2]	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
General Electric Co.	1,000 %	20.12.2023	$ 300	$ 16	0,00

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES - SCHUTZVERKAUF[1]

Index/Tranchen	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag[2]	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
CDX.EM-30 5-Year Index	1,000 %	20.12.2023	$ 3.145	$ 161	0,03
CDX.EM-31 5-Year Index	1,000	20.06.2024	946	39	0,01
CDX.EM-32 5-Year Index	1,000	20.12.2024	510	24	0,01
CDX.EM-34 5-Year Index	1,000	20.12.2025	2.208	11	0,00
CDX.EM-36 5-Year Index	1,000	20.12.2026	6.440	120	0,03
CDX.EM-38 5-Year Index	1,000	20.12.2027	900	39	0,01
CDX.EM-39 5-Year Index	1,000	20.06.2028	1.900	50	0,01
CDX.HY-36 5-Year Index	5,000	20.06.2026	1.862	(83)	(0,02)
CDX.HY-37 5-Year Index	5,000	20.12.2026	882	(4)	0,00
CDX.HY-39 5-Year Index	5,000	20.12.2027	2.772	77	0,02
CDX.HY-40 5-Year Index	5,000	20.06.2028	6.100	147	0,03
CDX.IG-40 5-Year Index	1,000	20.06.2028	600	6	0,00
				$ 587	0,13

ZINSSWAPS

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Erhalt[3]	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	3,500 %	20.09.2033	£ 6.200	$ 450	0,10
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,000	15.03.2029	¥ 2.430.000	313	0,07
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,020	20.09.2028	2.950.000	318	0,07
Zahlung	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,176	27.04.2027	160.000	0	0,00
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,400	15.06.2032	410.000	27	0,01
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,500	15.03.2042	220.000	50	0,01
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,711	27.04.2042	40.000	11	0,00
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	0,000	04.07.2023	$ 1.400	19	0,00
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	0,000	18.07.2023	1.100	15	0,00
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	0,000	02.08.2023	300	4	0,00
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	0,000	04.08.2023	52.700	727	0,16
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	0,000	06.09.2023	2.300	32	0,01
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	0,000	15.09.2023	33.800	(472)	(0,10)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	0,000	16.09.2023	50.200	(716)	(0,16)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	0,000	20.09.2023	10.900	(152)	(0,03)
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	0,500	16.06.2026	32.900	3.177	0,69
Zahlung[3]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	0,500	16.06.2028	26.200	(2.550)	(0,55)
Zahlung[3]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	0,750	15.12.2024	53.300	(3.044)	(0,66)
Zahlung[3]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	0,750	16.06.2031	13.442	(1.476)	(0,32)
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	0,750	16.06.2031	16.200	2.109	0,46
Erhalt[3]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	0,940	08.06.2026	2.000	185	0,04
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,000	15.06.2027	15.700	(1.518)	(0,33)
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,000	15.06.2027	1.200	89	0,02
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,000	15.06.2029	2.770	(322)	(0,07)
Erhalt[3]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,000	16.12.2030	1.766	308	0,07
Erhalt[3]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,235	12.05.2028	700	88	0,02
Erhalt[3]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,250	15.12.2026	500	58	0,01
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,250	15.12.2026	33.800	4.124	0,89

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Zahlung[3]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,250 %	17.06.2027	$ 12.000	$ (1.715)	(0,37)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,250	15.12.2028	3.900	(587)	(0,13)
Erhalt[3]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,250	17.06.2030	47.620	5.294	1,15
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,250	15.06.2032	5.950	(641)	(0,14)
Zahlung[3]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,250	16.06.2051	4.300	(923)	(0,20)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,270	04.11.2023	52.700	(863)	(0,19)
Erhalt[3]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,350	20.01.2027	3.400	339	0,07
Erhalt[3]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,360	20.07.2031	800	140	0,03
Erhalt[3]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,370	19.07.2031	500	87	0,02
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,380	04.01.2027	1.400	(146)	(0,03)
Erhalt[3]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,405	07.09.2031	1.300	222	0,05
Zahlung[3]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,425	18.01.2027	1.000	(95)	(0,02)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,443	18.01.2027	1.100	(111)	(0,02)
Erhalt[3]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,450	17.02.2027	2.400	227	0,05
Erhalt[3]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,450	16.07.2031	1.200	205	0,04
Zahlung[3]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,491	21.01.2051	900	(310)	(0,07)
Zahlung[3]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,500	15.12.2028	7.130	(990)	(0,21)
Erhalt[3]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,500	12.01.2029	578	74	0,02
Zahlung[3]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,500	05.10.2031	600	(99)	(0,02)
Zahlung[3]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,535	15.10.2031	600	(97)	(0,02)
Zahlung[3]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,535	22.10.2031	400	(64)	(0,01)
Zahlung[3]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,545	26.10.2031	400	(64)	(0,01)
Zahlung[3]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,550	20.01.2027	15.100	(1.358)	(0,29)
Zahlung[3]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,570	11.01.2027	800	(73)	(0,02)
Zahlung[3]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,580	16.02.2027	900	(79)	(0,02)
Zahlung[3]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,590	09.02.2051	7.200	(2.366)	(0,51)
Erhalt[3]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,600	16.01.2026	6.600	242	0,05
Erhalt[3]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,625	16.01.2050	3.100	1.025	0,22
Erhalt[3]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,625	03.02.2050	3.900	1.290	0,28
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,700	06.03.2024	2.300	(55)	(0,01)
Zahlung[3]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,700	17.02.2027	9.600	(797)	(0,17)
Zahlung[3]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,700	12.01.2029	2.100	(238)	(0,05)
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,740	16.12.2026	1.100	105	0,02
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,750	15.06.2027	26.000	850	0,18
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,750	15.06.2029	1.209	58	0,01
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,750	15.06.2032	1.878	102	0,02
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,750	15.06.2032	1.840	(174)	(0,04)
Erhalt[3]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,750	22.01.2050	7.600	2.377	0,51
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,768	02.02.2032	300	(46)	(0,01)
Erhalt[3]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,785	12.08.2051	700	222	0,05
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,817	05.04.2032	2.200	(297)	(0,06)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,872	06.04.2032	1.100	(143)	(0,03)
Erhalt[3]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,875	07.02.2050	400	115	0,02
Erhalt[3]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,895	18.10.2049	700	214	0,05
Erhalt[3]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,910	17.10.2049	700	211	0,05
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,928	25.03.2027	1.100	(90)	(0,02)
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,000	21.12.2027	1.250	29	0,01
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,000	21.12.2029	5.740	136	0,03
Zahlung[3]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,000	18.02.2032	900	(113)	(0,03)
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,000	21.12.2032	9.130	209	0,04
Erhalt[3]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,000	15.01.2050	1.400	380	0,08
Zahlung[3]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,000	15.12.2051	6.500	(2.182)	(0,47)
Erhalt[3]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,250	11.12.2049	7.100	1.562	0,34
Erhalt[3]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,250	12.03.2050	3.400	745	0,16
Erhalt[3]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,300	17.01.2026	4.600	167	0,04
Erhalt[3]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,350	17.01.2025	7.900	184	0,04
Erhalt[3]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,450	20.12.2024	15.900	377	0,08
Erhalt[3]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,500	18.12.2024	6.000	534	0,12
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,500	20.12.2024	10.900	191	0,04
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,850	30.08.2027	1.000	(52)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,955	04.10.2027	1.000	(46)	(0,01)
Erhalt[3]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,000	19.06.2024	41.600	2.177	0,47
Erhalt[3]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,000	19.06.2026	32.300	2.287	0,49
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,000	21.06.2030	2.090	28	0,01
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,000	21.06.2033	2.800	95	0,02
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,000	21.06.2033	160	(4)	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,050	07.09.2027	500	(22)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,050	08.09.2029	500	(22)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,050	06.09.2032	700	(30)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,080	23.02.2053	200	(4)	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,100	09.09.2029	500	(20)	0,00
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,250	21.06.2028	690	9	0,00
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,250	21.06.2028	590	(1)	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,300	06.03.2033	300	(7)	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,300	14.06.2033	1.000	(18)	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,340	23.02.2030	600	(15)	0,00
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,350	14.12.2032	200	6	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,370	01.03.2033	400	(7)	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,400	23.02.2033	200	(3)	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,405	01.03.2033	300	(4)	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,425	01.03.2033	300	(4)	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,430	27.02.2033	300	(4)	0,00

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits-datum		Nenn-betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,450 %	07.03.2033	$	600	$ (6)	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,470	22.02.2030		600	(10)	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,500	22.06.2030		900	(8)	0,00
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,500	22.05.2033		29.660	(83)	(0,02)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,500	21.06.2033		600	0	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,525	02.03.2030		200	(3)	0,00
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,610	12.12.2032		400	3	0,00
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,700	06.06.2033		16.970	(42)	(0,01)
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,750	13.12.2027		900	16	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,800	10.03.2028		600	(5)	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	4,040	20.06.2024		2.000	(15)	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	4,060	20.06.2024		8.100	(60)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	4,140	22.06.2024		3.400	(22)	(0,01)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	4,500	22.05.2025		65.460	(279)	(0,06)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	4,900	06.06.2025		37.050	(17)	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	5,100	22.05.2024		126.930	(140)	(0,03)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	5,400	06.06.2024		71.750	63	0,01
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,140	02.01.2025	BRL	1.300	(5)	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,160	02.01.2025		800	(3)	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,220	04.01.2027		1.500	3	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,245	04.01.2027		700	2	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,260	04.01.2027		800	2	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,350	02.01.2025		1.000	(3)	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,700	04.01.2027		400	2	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,715	04.01.2027		1.700	9	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,870	04.01.2027		4.000	25	0,01
Zahlung	1-Year BRL-CDI	12,000	02.01.2025		2.800	1	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	12,080	02.01.2025		4.700	3	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	12,140	02.01.2025		2.300	2	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	12,145	02.01.2025		2.300	2	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	12,160	02.01.2025		4.700	5	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	0,000	04.07.2023	$	1.400	(19)	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	0,000	18.07.2023		1.100	(15)	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	0,000	02.08.2023		300	(4)	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	0,000	04.08.2023		52.700	(723)	(0,16)
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	0,000	06.09.2023		2.300	(32)	(0,01)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	0,000	15.09.2023		33.800	480	0,10
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	0,000	16.09.2023		50.200	721	0,16
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	0,000	20.09.2023		10.900	153	0,03
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	0,500	16.09.2023		26.200	(343)	(0,07)
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	0,750	15.09.2023		53.300	(656)	(0,14)
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	0,750	16.09.2023		13.442	(167)	(0,04)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	0,940	08.09.2023		2.000	24	0,01
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,000	16.09.2023		1.766	21	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,235	12.08.2023		700	8	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,250	15.09.2023		500	6	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,250	16.09.2023		4.300	(48)	(0,01)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,250	17.09.2023		35.620	382	0,08
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,350	20.07.2023		3.400	23	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,360	20.07.2023		800	5	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,370	19.07.2023		500	3	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,405	07.09.2023		1.300	9	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,425	18.07.2023		1.000	(6)	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,450	16.07.2023		1.200	7	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,450	17.08.2023		2.400	15	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,491	21.07.2023		900	(5)	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,500	05.07.2023		600	(6)	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,500	12.07.2023		578	3	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,500	15.09.2023		7.130	(74)	(0,02)
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,535	15.07.2023		600	(6)	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,535	22.07.2023		400	(4)	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,545	26.07.2023		400	(4)	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,550	20.07.2023		15.100	(85)	(0,02)
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,570	11.07.2023		800	(4)	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,580	16.08.2023		900	(5)	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,590	09.08.2023		7.200	(41)	(0,01)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,625	16.07.2023		3.100	16	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,625	03.08.2023		3.900	21	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,700	12.07.2023		2.100	(10)	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	1,700	17.08.2023		9.600	(50)	(0,01)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,750	22.07.2023		7.600	35	0,01
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,785	12.08.2023		700	4	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,875	07.08.2023		400	2	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,895	18.07.2023		700	6	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,910	17.07.2023		700	6	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,000	15.07.2023		1.400	5	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	2,000	18.08.2023		900	(3)	0,00
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	2,000	15.09.2023		6.500	(60)	(0,01)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,250	11.09.2023		7.100	60	0,01
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,250	12.09.2023		3.400	10	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,500	18.09.2023		6.000	46	0,01
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	3,000	19.09.2023		73.900	477	0,10

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits-datum		Nenn-betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Zahlung	6-Month AUD-BBR-BBSW	2,750 %	17.06.2026	AUD	460	$ (18)	0,00
Zahlung	6-Month AUD-BBR-BBSW	3,000	21.03.2027		18.640	(979)	(0,21)
Zahlung	6-Month AUD-BBR-BBSW	3,250	17.12.2024		1.600	(81)	(0,02)
Zahlung	6-Month AUD-BBR-BBSW	3,500	17.06.2025		19.492	(1.255)	(0,27)
Zahlung	6-Month AUD-BBR-BBSW	4,250	17.12.2024		650	(59)	(0,01)
Zahlung	6-Month AUD-BBR-BBSW	4,750	18.06.2024		400	(42)	(0,01)
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	0,150	18.03.2030	€	6.200	1.255	0,27
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	0,250	18.03.2050		2.300	1.001	0,22
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	0,329	30.12.2025		100	11	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	0,363	30.06.2025		200	18	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	0,395	30.12.2024		100	7	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	0,425	28.06.2024		200	10	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	0,453	29.12.2023		200	5	0,00
Erhalt[3]	6-Month EUR-EURIBOR	0,830	09.12.2052		6.800	331	0,07
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,000	21.09.2032		11.880	(1.115)	(0,24)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,100	11.04.2024		1.400	(22)	(0,01)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,100	13.04.2024		2.900	(46)	(0,01)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,100	17.05.2024		1.300	(22)	(0,01)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,250	26.04.2024		1.400	(19)	0,00
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,250	28.04.2024		1.300	(19)	0,00
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,250	03.05.2024		1.300	(19)	0,00
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,547	09.03.2033		800	(18)	0,00
Erhalt[3]	6-Month EUR-EURIBOR	3,000	20.09.2033		3.700	(44)	(0,01)
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	5,160	06.06.2025	MXN	9.300	(46)	(0,01)
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	5,535	04.05.2027		18.500	(112)	(0,02)
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	5,950	30.01.2026		12.300	5	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	5,980	26.08.2024		500	0	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	5,990	30.01.2026		15.000	5	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	6,080	10.03.2026		20.700	1	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	6,350	01.09.2023		3.300	6	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	6,490	08.09.2026		13.700	(9)	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	6,620	18.02.2030		600	0	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	6,710	20.09.2029		500	0	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	7,150	11.06.2027		28.100	(49)	(0,01)
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	7,165	06.09.2032		3.000	(3)	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	7,200	11.06.2027		2.900	(5)	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	7,360	21.08.2037		3.100	(6)	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	7,370	11.10.2027		14.800	(30)	(0,01)
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	7,380	04.11.2026		400	(1)	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	7,380	14.08.2037		700	0	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	7,480	18.06.2037		1.300	(3)	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	7,495	14.01.2032		8.100	(15)	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	7,498	15.01.2032		33.500	(64)	(0,01)
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	7,603	14.04.2025		49.000	(116)	(0,03)
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	7,610	15.04.2025		3.000	(7)	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	7,670	05.03.2025		52.900	(111)	(0,02)
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	7,710	07.03.2025		6.400	(14)	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	7,715	07.03.2025		6.300	(13)	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	7,800	28.12.2027		2.900	4	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	7,818	17.02.2027		11.400	(35)	(0,01)
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	7,865	02.02.2027		11.900	(37)	(0,01)
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	7,910	30.12.2027		600	1	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	7,984	10.12.2027		6.800	7	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	7,990	21.12.2027		100	0	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	8,005	21.12.2027		37.500	60	0,01
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	8,010	04.02.2027		5.200	(18)	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	8,030	31.01.2028		4.600	4	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	8,050	31.01.2028		3.400	2	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	8,090	15.01.2027		13.000	(48)	(0,01)
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	8,103	04.01.2038		5.600	(2)	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	8,120	15.01.2027		2.700	(10)	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	8,410	31.03.2027		11.100	5	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	8,660	04.04.2024		38.500	43	0,01
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	8,675	03.04.2024		92.600	103	0,02
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	8,701	31.03.2032		19.500	(41)	(0,01)
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	8,730	06.04.2027		16.500	(1)	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	8,732	30.03.2032		8.200	(18)	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	8,750	05.04.2024		39.700	43	0,01
Zahlung	UKRPI	4,000	15.09.2031	£	300	(57)	(0,01)
Zahlung	UKRPI	4,020	15.10.2031		400	(73)	(0,02)
Zahlung	UKRPI	4,055	15.09.2031		400	(75)	(0,02)
Zahlung	UKRPI	4,066	15.09.2031		600	(101)	(0,02)
Zahlung	UKRPI	4,140	15.10.2031		1.000	(168)	(0,04)
Zahlung	UKRPI	4,250	15.11.2031		900	(128)	(0,03)
Zahlung	UKRPI	4,400	15.10.2031		400	(59)	(0,01)
						$ 6.699	1,45
Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate						**$ 7.302**	**1,58**

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

(2) Der maximal mögliche Betrag, den der Fonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

(3) Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft.

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

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

VERKAUFSOPTIONEN

ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag[1]	Aufgeld	Markt-wert	% des Nettovermögens
BOA	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,150 %	01.12.2023	1.100	$ (3)	$ 0	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,650	01.12.2023	1.100	(3)	(15)	(0,01)
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,380	31.07.2023	300	(1)	(1)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,780	31.07.2023	300	(1)	(1)	0,00
	Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,070	10.07.2023	200	(1)	(1)	0,00
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,370	10.07.2023	200	(1)	0	0,00
	Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,060	14.07.2023	100	(1)	(1)	0,00
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,360	14.07.2023	100	(1)	0	0,00
BPS	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,200	06.07.2023	200	(1)	0	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,650	06.07.2023	200	(1)	0	0,00
	Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,000	03.07.2023	100	(1)	0	0,00
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,400	03.07.2023	100	(1)	0	0,00
BRC	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,260	26.07.2023	100	0	0	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,660	26.07.2023	100	0	(1)	0,00
	Call - OTC 7-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,350	27.07.2023	200	0	0	0,00
	Put - OTC 7-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,850	27.07.2023	200	0	(1)	0,00
CBK	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,690	02.04.2024	300	(2)	0	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,690	02.04.2024	300	(2)	(6)	0,00
DUB	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,920	13.10.2023	1.000	(6)	0	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,920	13.10.2023	1.000	(6)	(23)	(0,01)
FAR	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,688	02.04.2024	600	(5)	(1)	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,688	02.04.2024	600	(5)	(11)	0,00
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,781	05.04.2024	1.000	(8)	(1)	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,781	05.04.2024	1.000	(8)	(18)	(0,01)
	Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,000	03.07.2023	200	(1)	0	0,00
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,400	03.07.2023	200	(1)	0	0,00
	Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,100	31.08.2023	800	(6)	(1)	0,00
	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,800	31.08.2023	800	(6)	(8)	0,00
GLM	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,920	13.10.2023	700	(4)	0	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,920	13.10.2023	700	(4)	(15)	(0,01)
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,018	20.10.2023	500	(3)	0	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,018	20.10.2023	500	(3)	(10)	0,00
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,140	23.10.2023	500	(4)	0	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,140	23.10.2023	500	(4)	(10)	0,00
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,190	23.10.2023	500	(4)	0	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,190	23.10.2023	500	(4)	(9)	0,00
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,225	23.10.2023	500	(3)	0	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,225	23.10.2023	500	(3)	(9)	0,00
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,973	25.10.2023	600	(4)	0	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,973	25.10.2023	600	(4)	(12)	0,00
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,841	27.10.2023	600	(4)	0	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,841	27.10.2023	600	(4)	(13)	0,00
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,088	03.11.2023	600	(4)	0	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,088	03.11.2023	600	(4)	(12)	0,00
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,910	10.11.2023	600	(4)	0	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,910	10.11.2023	600	(4)	(13)	0,00
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,250	17.11.2023	1.100	(4)	0	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,750	17.11.2023	1.100	(4)	(14)	0,00
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,150	20.11.2023	1.100	(4)	0	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,650	20.11.2023	1.100	(4)	(15)	(0,01)
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,250	07.12.2023	1.100	(3)	0	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,750	07.12.2023	1.100	(3)	(14)	0,00
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,697	02.04.2024	1.200	(9)	(1)	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,697	02.04.2024	1.200	(9)	(22)	(0,01)
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,721	08.04.2024	600	(5)	(1)	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,721	08.04.2024	600	(5)	(11)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,260	26.07.2023	300	(1)	(1)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,660	26.07.2023	300	(1)	(2)	0,00
	Call - OTC 7-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,350	27.07.2023	200	(1)	0	0,00
	Put - OTC 7-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,850	27.07.2023	200	(1)	(1)	0,00
JPM	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,300	10.07.2023	200	(1)	0	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,750	10.07.2023	200	(1)	0	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,250	20.07.2023	300	(1)	0	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,650	20.07.2023	300	(1)	(1)	0,00
MYC	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,993	11.10.2023	600	(4)	0	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	2,993	11.10.2023	600	(4)	(13)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,200	06.07.2023	200	(1)	0	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,650	06.07.2023	200	(1)	0	0,00

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag[1]	Aufgeld	Markt-wert	% des Nettovermögens
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,300 %	10.07.2023	200	$ (1)	$ 0	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,750	10.07.2023	200	(1)	0	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,270	24.07.2023	300	(1)	(1)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,670	24.07.2023	300	(1)	(1)	0,00
							$ (212)	$ (291)	(0,06)

OPTIONEN AUF WERTPAPIERE

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag[1]	Aufgeld	Markt-wert	% des Nettovermögens
SAL	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security. TBA 4,500 % fällig am 01.08.2053	$ 95,875	07.08.2023	500	$ (3)	$ (2)	0,00
	Call - OTC Uniform Mortgage-Backed Security. TBA 4,500 % fällig am 01.08.2053	97,875	07.08.2023	500	(3)	(1)	0,00
					$ (6)	$ (3)	0,00

[1] Der Nennbetrag stellt die Anzahl der Kontrakte dar.

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMMISSIONEN - SCHUTZVERKAUF[1]

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag[2]	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Markt-wert	% des Nettovermögens
BOA	Turkey Government International Bond	1,000 %	20.12.2023	$ 400	$ (29)	$ 27	$ (2)	0,00
	Turkey Government International Bond	1,000	20.12.2024	100	(11)	7	(4)	0,00
BPS	Colombia Government International Bond	1,000	20.12.2027	200	(18)	9	(9)	0,00
BRC	Colombia Government International Bond	1,000	20.12.2026	300	(14)	8	(6)	0,00
	Turkey Government International Bond	1,000	20.12.2023	900	(62)	58	(4)	0,00
	Turkey Government International Bond	1,000	20.06.2024	400	(36)	28	(8)	0,00
	Turkey Government International Bond	1,000	20.12.2024	940	(110)	73	(37)	(0,01)
CBK	Brazil Government International Bond	1,000	20.12.2024	500	(9)	13	4	0,00
	Colombia Government International Bond	1,000	20.06.2024	200	(2)	3	1	0,00
	Colombia Government International Bond	1,000	20.12.2024	500	2	0	2	0,00
	Colombia Government International Bond	1,000	20.06.2027	100	(4)	1	(3)	0,00
	Mexico Government International Bond	1,000	20.06.2024	700	(11)	17	6	0,00
	Turkey Government International Bond	1,000	20.12.2024	100	(10)	6	(4)	0,00
GST	Brazil Government International Bond	1,000	20.12.2024	600	(9)	14	5	0,00
	Colombia Government International Bond	1,000	20.06.2027	100	(4)	1	(3)	0,00
	Colombia Government International Bond	1,000	20.12.2027	100	(9)	5	(4)	0,00
	Mexico Government International Bond	1,000	20.12.2024	800	(7)	16	9	0,00
	Mexico Government International Bond	1,000	20.06.2028	300	(5)	5	0	0,00
	South Africa Government International Bond	1,000	20.12.2023	100	(5)	5	0	0,00
	Turkey Government International Bond	1,000	20.06.2024	400	(36)	28	(8)	0,00
	Turkey Government International Bond	1,000	20.12.2024	900	(101)	66	(35)	(0,01)
HUS	Brazil Government International Bond	1,000	20.12.2023	200	(6)	7	1	0,00
	Brazil Government International Bond	1,000	20.06.2024	1.000	(29)	37	8	0,00
JPM	Mexico Government International Bond	1,000	20.12.2023	100	(3)	3	0	0,00
	Mexico Government International Bond	1,000	20.06.2026	300	(2)	6	4	0,00
	South Africa Government International Bond	1,000	20.12.2023	800	(44)	45	1	0,00
MYC	Colombia Government International Bond	1,000	20.06.2027	200	(7)	1	(6)	0,00
	Colombia Government International Bond	1,000	20.12.2027	200	(18)	9	(9)	0,00
	Mexico Government International Bond	1,000	20.12.2024	600	(5)	11	6	0,00
	Mexico Government International Bond	1,000	20.12.2025	100	(1)	2	1	0,00
	Mexico Government International Bond	1,000	20.12.2026	1.100	3	9	12	0,00
	Mexico Government International Bond	1,000	20.06.2027	400	(1)	5	4	0,00
	Mexico Government International Bond	1,000	20.06.2028	1.700	(39)	37	(2)	0,00
					$ (642)	$ 562	$ (80)	(0,02)

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES - SCHUTZVERKAUF[1]

Kontrahent	Index/Tranchen	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag[2]	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Markt-wert	% des Nettovermögens
BOA	ABX.HE.AAA.6-2 Index	0,110 %	25.05.2046	$ 311	$ (73)	$ 61	$ (12)	0,00
DUB	CMBX.NA.AAA.10 Index	0,500	17.11.2059	400	(7)	5	(2)	0,00
	CMBX.NA.AAA.7 Index	0,500	17.01.2047	225	(10)	10	0	0,00
FBF	CMBX.NA.AAA.12 Index	0,500	17.08.2061	25	0	0	0	0,00
	CMBX.NA.AAA.6 Index	0,500	11.05.2063	1	0	0	0	0,00
GST	CMBX.NA.AAA.10 Index	0,500	17.11.2059	16.000	(8)	(56)	(64)	(0,01)
	CMBX.NA.AAA.11 Index	0,500	18.11.2054	7.300	(38)	(13)	(51)	(0,01)
	CMBX.NA.AAA.6 Index	0,500	11.05.2063	1	0	0	0	0,00
	CMBX.NA.AAA.8 Index	0,500	17.10.2057	8.700	(339)	337	(2)	0,00
	CMBX.NA.AAA.9 Index	0,500	17.09.2058	298	(12)	11	(1)	0,00
MEI	CMBX.NA.AAA.12 Index	0,500	17.08.2061	500	(4)	(2)	(6)	0,00
	CMBX.NA.AAA.8 Index	0,500	17.10.2057	200	(11)	11	0	0,00
	CMBX.NA.AAA.9 Index	0,500	17.09.2058	596	(47)	46	(1)	0,00
MYC	ABX.HE.AAA.6-2 Index	0,110	25.05.2046	493	(115)	95	(20)	(0,01)
	CMBX.NA.AAA.12 Index	0,500	17.08.2061	500	(4)	(2)	(6)	0,00
	CMBX.NA.AAA.6 Index	0,500	11.05.2063	1	0	0	0	0,00
	CMBX.NA.AAA.8 Index	0,500	17.10.2057	100	(6)	6	0	0,00
SAL	CMBX.NA.AAA.10 Index	0,500	17.11.2059	2.075	17	(25)	(8)	0,00
	CMBX.NA.AAA.11 Index	0,500	18.11.2054	1.200	6	(14)	(8)	0,00
	CMBX.NA.AAA.12 Index	0,500	17.08.2061	300	(1)	(2)	(3)	0,00

Kontrahent	Index/Tranchen	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag[2]	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Markt-wert	% des Nettovermögens
	CMBX.NA.AAA.9 Index	0,500 %	17.09.2058	$ 15.400	$ 15	$ (44)	$ (29)	(0,01)
UAG	CMBX.NA.AAA.8 Index	0,500	17.10.2057	100	(6)	6	0	0,00
					$ (643)	$ 430	$ (213)	(0,04)

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

(2) Der maximal mögliche Betrag, den der Fonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung		Zu erhaltende Währung		Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
AZD	07.2023	AUD	1.090	$	723	$ 0	$ (2)	$ (2)	0,00
	07.2023	$	245	AUD	375	4	0	4	0,00
	08.2023		724		1.090	2	0	2	0,00
BOA	07.2023	KRW	122.877	$	94	1	0	1	0,00
	07.2023	MXN	14.546		790	0	(57)	(57)	(0,01)
	07.2023	$	1.369	AUD	2.099	29	0	29	0,01
	08.2023		1.357	NZD	2.140	0	(46)	(46)	(0,01)
	09.2023	TWD	14.084	$	464	11	0	11	0,00
	09.2023	$	762	KRW	965.543	0	(26)	(26)	(0,01)
BPS	07.2023	AUD	865	$	572	0	(4)	(4)	0,00
	07.2023	CHF	141		157	0	0	0	0,00
	07.2023	KRW	18.299		14	0	0	0	0,00
	07.2023	$	10.660	€	9.729	0	(45)	(45)	(0,01)
	07.2023		436	£	343	0	0	0	0,00
	07.2023		6.065	¥	842.591	0	(236)	(236)	(0,05)
	08.2023	CNH	2.308	$	334	16	0	16	0,00
	08.2023	€	9.571		10.502	45	0	45	0,01
	08.2023	KRW	1.222.113		932	3	0	3	0,00
	08.2023	TWD	7.050		231	4	0	4	0,00
	08.2023	$	517	AUD	779	3	0	3	0,00
	08.2023		157	CHF	140	0	0	0	0,00
	08.2023		9	CNY	62	0	(1)	(1)	0,00
	08.2023		678	INR	55.704	0	0	0	0,00
	08.2023	ZAR	14.618	$	788	17	0	17	0,00
	09.2023	$	906	IDR	13.614.837	0	(2)	(2)	0,00
	10.2023	ZAR	36.636	$	1.968	50	0	50	0,01
	12.2023	MXN	555		31	0	0	0	0,00
BRC	07.2023	KRW	124.146		95	1	0	1	0,00
	08.2023	ZAR	15.914		857	19	(1)	18	0,00
	09.2023	IDR	24.061		2	0	0	0	0,00
CBK	07.2023	PEN	3.410		939	0	(2)	(2)	0,00
	07.2023	$	990	CLP	801.308	8	0	8	0,00
	07.2023		918	PEN	3.410	23	0	23	0,01
	08.2023	TWD	7.339	$	240	5	0	5	0,00
	08.2023	$	1.041	CLP	851.403	13	0	13	0,00
	08.2023		710	NOK	7.408	0	(18)	(18)	0,00
	08.2023		536	PEN	2.094	40	0	40	0,01
	09.2023	KRW	123.275	$	95	1	0	1	0,00
CLY	08.2023	$	802	NOK	8.403	0	(16)	(16)	0,00
DUB	07.2023	PEN	3.410	$	932	0	(8)	(8)	0,00
	07.2023	$	6.131	BRL	33.218	756	0	756	0,16
	07.2023		1.871	PEN	6.820	10	0	10	0,00
	10.2023	ZAR	3.684	$	202	9	0	9	0,00
FAR	07.2023	$	2	CLP	1.229	0	0	0	0,00
GLM	07.2023	BRL	33.323	$	6.901	0	(6)	(6)	0,00
	07.2023	KRW	48.362		37	0	0	0	0,00
	08.2023		583.955		444	0	0	0	0,00
	08.2023	$	1.047	INR	86.012	0	0	0	0,00
	08.2023		312	NOK	3.313	0	(3)	(3)	0,00
	09.2023		6.901	BRL	33.692	5	0	5	0,00
	10.2023	ZAR	6.536	$	348	6	0	6	0,00
JPM	07.2023	£	343		434	0	(2)	(2)	0,00
	07.2023	¥	286.941		2.006	21	0	21	0,00
	07.2023	MXN	4.651		270	0	(1)	(1)	0,00
	08.2023	CNH	1.853		268	13	0	13	0,00
	08.2023	KRW	102.898		78	0	0	0	0,00
	08.2023	$	10	CNY	66	0	(1)	(1)	0,00
	08.2023		434	£	343	2	0	2	0,00
	08.2023		2.006	¥	285.722	0	(21)	(21)	0,00
	08.2023		115	NOK	1.222	0	(1)	(1)	0,00
	08.2023		167	ZAR	3.060	0	(6)	(6)	0,00
	09.2023	IDR	40.474	$	3	0	0	0	0,00
	09.2023	KRW	343.306		264	2	0	2	0,00
	09.2023	PEN	1.888		513	0	(5)	(5)	0,00
	09.2023	$	1	IDR	8.789	0	0	0	0,00

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung		Zu erhaltende Währung		Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
	12.2023	$	713	INR	58.839	$ 0	$ 0	$ 0	0,00
MBC	07.2023	£	5.561	$	6.884	0	(187)	(187)	(0,04)
	08.2023	NZD	447		272	0	(1)	(1)	0,00
	09.2023	$	1.403	KRW	1.789.835	0	(39)	(39)	(0,01)
MYI	07.2023	IDR	122.234	$	8	0	0	0	0,00
	07.2023	$	292	€	268	0	0	0	0,00
	07.2023		8	IDR	122.234	0	0	0	0,00
	08.2023	TWD	14.254	$	469	11	0	11	0,00
	08.2023	$	113	ZAR	2.076	0	(4)	(4)	0,00
	09.2023	IDR	122.340	$	8	0	0	0	0,00
	09.2023	KRW	663.661		511	5	0	5	0,00
	09.2023	$	496	IDR	7.402.494	0	(4)	(4)	0,00
	09.2023		1.572	KRW	2.011.485	0	(39)	(39)	(0,01)
RBC	07.2023	AUD	101	$	69	2	0	2	0,00
	07.2023	$	5.141	MXN	98.927	618	0	618	0,13
	08.2023	MXN	19.475	$	1.124	0	(3)	(3)	0,00
SCX	07.2023	AUD	1.601		1.063	0	(3)	(3)	0,00
	07.2023	$	1.443	AUD	2.209	27	0	27	0,01
	07.2023		165	CHF	148	1	0	1	0,00
	08.2023	CNH	878	$	128	7	0	7	0,00
	08.2023	NZD	2.360		1.435	0	(11)	(11)	0,00
	08.2023	TWD	5.257		172	3	0	3	0,00
	08.2023	$	1.064	AUD	1.601	3	0	3	0,00
	08.2023		724	CNH	4.969	0	(38)	(38)	(0,01)
	08.2023		474	NZD	760	0	(9)	(9)	0,00
	09.2023	KRW	122.797	$	95	1	0	1	0,00
	09.2023	TWD	11.780		386	7	0	7	0,00
	09.2023	$	2.122	IDR	31.725.606	0	(14)	(14)	0,00
	09.2023	ZAR	9.141	$	521	41	0	41	0,01
SOG	07.2023	€	9.729		10.466	0	(149)	(149)	(0,03)
	07.2023	$	1.620	AUD	2.476	28	0	28	0,01
SSB	07.2023	CLP	803.688	$	1.000	0	0	0	0,00
	07.2023	KRW	91.511		70	0	0	0	0,00
	07.2023	PEN	3.410		935	0	(5)	(5)	0,00
	08.2023	$	1.000	CLP	806.009	0	0	0	0,00
	08.2023		934	PEN	3.410	5	0	5	0,00
	09.2023		2.916	BRL	14.782	115	0	115	0,03
	12.2023		73	INR	6.025	0	0	0	0,00
TOR	07.2023	AUD	1.971	$	1.302	0	(10)	(10)	0,00
	07.2023	$	857	AUD	1.310	15	0	15	0,00
	07.2023		7.066	£	5.561	4	0	4	0,00
	08.2023	£	5.561	$	7.068	0	(3)	(3)	0,00
	08.2023	$	1.303	AUD	1.971	10	0	10	0,00
UAG	07.2023	AUD	3.141	$	2.097	11	(4)	7	0,00
	07.2023	$	196	AUD	300	3	0	3	0,00
	08.2023		2.099		3.141	4	(11)	(7)	0,00
	08.2023	ZAR	12.317	$	642	1	(8)	(7)	0,00
	09.2023		6.658		380	30	0	30	0,01
						$ 2.071	$ (1.052)	$ 1.019	0,22

ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklassen Institutional EUR (Hedged) thesaurierend, Class E EUR (Hedged) thesaurierend, Class E EUR (Hedged) ausschüttend II, Class T EUR (Hedged) thesaurierend und Class T EUR (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung		Zu erhaltende Währung		Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
AZD	07.2023	AUD	348	$	228	$ 0	$ (4)	$ (4)	0,00
	07.2023	$	509	AUD	767	2	0	2	0,00
	08.2023	AUD	767	$	510	0	(2)	(2)	0,00
BOA	07.2023		437		284	0	(7)	(7)	0,00
	07.2023	DKK	536		77	0	(1)	(1)	0,00
	07.2023	€	1.281		1.400	2	0	2	0,00
	07.2023	¥	85.765		617	23	0	23	0,01
	07.2023	KRW	4.104		3	0	0	0	0,00
	07.2023	NOK	2.048		186	0	(5)	(5)	0,00
	07.2023	SEK	192		18	0	0	0	0,00
	07.2023	$	3	BRL	15	0	0	0	0,00
	07.2023		143	DKK	974	0	(1)	(1)	0,00
	07.2023		130.129	€	121.072	1.962	0	1.962	0,41
	08.2023	DKK	972	$	143	1	0	1	0,00
BPS	07.2023	BRL	0		0	0	0	0	0,00
	07.2023	CHF	93		103	0	(1)	(1)	0,00
	07.2023	DKK	2		0	0	0	0	0,00
	07.2023	€	120.359		131.874	563	(1)	562	0,12
	07.2023	¥	928.272		6.681	259	0	259	0,06
	07.2023	TWD	73.345		2.395	40	0	40	0,01
	07.2023	$	363	AUD	549	2	0	2	0,00
	07.2023		7.673	CHF	6.862	0	(3)	(3)	0,00
	07.2023		401	CNY	2.900	0	(2)	(2)	0,00

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung		Zu erhaltende Währung		Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
	07.2023	$	128.372	€	119.415	$ 1.910	$ 0	$ 1.910	0,41
	07.2023		46	NOK	500	0	0	0	0,00
	08.2023	AUD	549	$	364	0	(2)	(2)	0,00
	08.2023	CHF	6.843		7.673	3	0	3	0,00
	08.2023	CNY	2.895		401	1	0	1	0,00
	08.2023	NOK	499		46	0	0	0	0,00
	08.2023	$	130.715	€	119.131	0	(566)	(566)	(0,12)
BRC	07.2023		941	KRW	1.241.307	2	0	2	0,00
	08.2023	KRW	1.239.746	$	941	0	(2)	(2)	0,00
CBK	07.2023	CAD	2.202		1.616	0	(48)	(48)	(0,01)
	07.2023	€	115.521		125.490	3	(546)	(543)	(0,12)
	07.2023	MXN	7.597		422	0	(21)	(21)	0,00
	07.2023	NOK	182		16	0	(1)	(1)	0,00
	07.2023	$	1.119	BRL	5.351	0	(10)	(10)	0,00
	07.2023		191	ILS	691	0	(4)	(4)	0,00
	07.2023		442	MXN	7.597	1	0	1	0,00
	07.2023		2.361	TWD	73.569	1	0	1	0,00
	08.2023	BRL	5.351	$	1.113	9	0	9	0,00
	08.2023	ILS	691		191	4	0	4	0,00
	08.2023	MXN	7.597		440	0	(1)	(1)	0,00
	08.2023	TWD	73.570		2.361	0	0	0	0,00
	08.2023	$	115.169	€	105.782	398	0	398	0,09
CLY	07.2023	DKK	1.576	$	228	0	(3)	(3)	0,00
	07.2023	$	193	CHF	173	1	0	1	0,00
	08.2023	CHF	173	$	193	0	(1)	(1)	0,00
GLM	07.2023	BRL	5.367		1.072	0	(41)	(41)	(0,01)
	07.2023	MYR	1.764		393	15	0	15	0,00
	07.2023	$	286	NOK	3.082	2	0	2	0,00
	08.2023	NOK	3.079	$	286	0	(2)	(2)	0,00
JPM	07.2023	€	118.969		129.903	107	0	107	0,02
	07.2023	INR	15.846		191	0	(2)	(2)	0,00
	07.2023	$	193	INR	15.854	0	0	0	0,00
	07.2023		2.415	¥	345.326	0	(25)	(25)	(0,01)
	07.2023		47	SGD	64	0	0	0	0,00
	08.2023	INR	15.868	$	193	0	0	0	0,00
	08.2023	¥	343.859		2.415	26	0	26	0,01
	08.2023	SGD	64		47	0	0	0	0,00
	08.2023	$	130.084	€	118.969	0	(111)	(111)	(0,02)
MBC	07.2023	CAD	1	$	1	0	0	0	0,00
	07.2023	CNY	20		3	0	0	0	0,00
	07.2023	€	3.969		4.268	2	(63)	(61)	(0,01)
	07.2023	£	4.119		5.099	0	(138)	(138)	(0,03)
	07.2023	SGD	1.233		912	2	0	2	0,00
	07.2023	$	615	£	494	12	0	12	0,00
MYI	07.2023	ILS	690	$	185	0	(1)	(1)	0,00
	07.2023	SEK	9.623		896	6	0	6	0,00
	07.2023	$	644	CHF	583	8	0	8	0,00
	07.2023		127	DKK	868	0	0	0	0,00
	07.2023		538	IDR	8.101.622	2	0	2	0,00
	07.2023		380	MYR	1.764	0	(2)	(2)	0,00
	07.2023		910	SEK	9.830	0	0	0	0,00
	07.2023		945	SGD	1.277	0	(2)	(2)	0,00
	07.2023	ZAR	5.401	$	275	0	(11)	(11)	0,00
	08.2023	DKK	867		127	0	0	0	0,00
	08.2023	IDR	8.104.686		538	0	(1)	(1)	0,00
	08.2023	MYR	1.764		381	2	0	2	0,00
	08.2023	SEK	9.818		910	0	0	0	0,00
	08.2023	SGD	1.275		945	1	0	1	0,00
SCX	07.2023	CHF	7.227		8.044	0	(35)	(35)	(0,01)
	07.2023	$	748	AUD	1.127	2	0	2	0,00
	07.2023		1	IDR	11.432	0	0	0	0,00
	08.2023	AUD	1.127	$	749	0	(2)	(2)	0,00
SOG	07.2023		2.302		1.506	0	(26)	(26)	(0,01)
	07.2023	HKD	21.181		2.706	3	0	3	0,00
	07.2023	$	128.459	€	119.415	1.822	0	1.822	0,39
	07.2023		289	ZAR	5.408	0	(3)	(3)	0,00
	08.2023	ZAR	5.423	$	289	3	0	3	0,00
TOR	07.2023	AUD	1.218		797	0	(14)	(14)	0,00
	07.2023	$	916	AUD	1.387	7	0	7	0,00
	07.2023		1.665	CAD	2.203	1	(1)	0	0,00
	07.2023		4.607	£	3.625	2	0	2	0,00
	07.2023		4.644	¥	668.664	0	(17)	(17)	0,00
	08.2023	AUD	1.387	$	917	0	(7)	(7)	0,00
	08.2023	CAD	2.202		1.665	1	(1)	0	0,00
	08.2023	£	3.625		4.608	0	(2)	(2)	0,00
	08.2023	¥	665.829		4.644	17	0	17	0,00
UAG	07.2023	AUD	279		183	0	(3)	(3)	0,00
	07.2023	CHF	471		524	0	(2)	(2)	0,00
	07.2023	CNY	2.887		411	13	0	13	0,00
	07.2023	IDR	8.070.857		538	0	0	0	0,00
	07.2023	KRW	1.235.012		937	0	(1)	(1)	0,00
	07.2023	NOK	1.495		135	0	(4)	(4)	0,00
	07.2023	SGD	109		81	0	0	0	0,00

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung		Zu erhaltende Währung		Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
	07.2023	$	500	AUD	756	$ 3	$ 0	$ 3	0,00
	07.2023		189	CHF	169	0	0	0	0,00
	08.2023	AUD	756	$	500	0	(3)	(3)	0,00
	08.2023	CHF	168		189	0	0	0	0,00
						$ 7.246	$ (1.752)	$ 5.494	1,18

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklasse Institutional GBP (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung		Zu erhaltende Währung		Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2023	AUD	1	$	1	$ 0	$ 0	$ 0	0,00
	07.2023	CNY	2		0	0	0	0	0,00
	07.2023	DKK	1		0	0	0	0	0,00
	07.2023	KRW	692		1	0	0	0	0,00
	07.2023	NOK	2		0	0	0	0	0,00
	07.2023	SEK	0		0	0	0	0	0,00
	07.2023	$	0	BRL	0	0	0	0	0,00
	07.2023		0	DKK	0	0	0	0	0,00
	07.2023		2	£	1	0	0	0	0,00
	07.2023		1	SEK	6	0	0	0	0,00
	08.2023	DKK	0	$	0	0	0	0	0,00
	08.2023	SEK	6		1	0	0	0	0,00
BPS	07.2023	CHF	0		0	0	0	0	0,00
	07.2023	¥	606		4	0	0	0	0,00
	07.2023	TWD	46		2	0	0	0	0,00
	07.2023	$	0	AUD	0	0	0	0	0,00
	07.2023		5	CHF	4	0	0	0	0,00
	07.2023		0	CNY	2	0	0	0	0,00
	07.2023		6	€	6	0	0	0	0,00
	07.2023		83	£	67	2	0	2	0,00
	07.2023		0	NOK	2	0	0	0	0,00
	08.2023	AUD	0	$	0	0	0	0	0,00
	08.2023	CHF	4		5	0	0	0	0,00
	08.2023	CNY	2		0	0	0	0	0,00
	08.2023	€	6		6	0	0	0	0,00
	08.2023	NOK	2		0	0	0	0	0,00
CBK	07.2023	CAD	1		1	0	0	0	0,00
	07.2023	MXN	4		0	0	0	0	0,00
	07.2023	NOK	0		0	0	0	0	0,00
	07.2023	TWD	5		0	0	0	0	0,00
	07.2023	$	1	BRL	3	0	0	0	0,00
	07.2023		0	MXN	8	0	0	0	0,00
	07.2023		2	TWD	51	0	0	0	0,00
	08.2023	BRL	3	$	1	0	0	0	0,00
	08.2023	MXN	8		0	0	0	0	0,00
	08.2023	TWD	51		2	0	0	0	0,00
JPM	07.2023	BRL	3		1	0	0	0	0,00
	07.2023	£	69		87	0	0	0	0,00
	07.2023	INR	2		0	0	0	0	0,00
	07.2023	SGD	1		0	0	0	0	0,00
	07.2023	$	0	INR	2	0	0	0	0,00
	07.2023		2	¥	226	0	0	0	0,00
	08.2023	INR	2	$	0	0	0	0	0,00
	08.2023	¥	225		2	0	0	0	0,00
	08.2023	$	87	£	69	0	0	0	0,00
MYI	07.2023	ILS	0	$	0	0	0	0	0,00
	07.2023	MXN	4		0	0	0	0	0,00
	07.2023	SEK	6		1	0	0	0	0,00
	07.2023	$	0	DKK	0	0	0	0	0,00
	07.2023		83	£	67	2	0	2	0,00
	07.2023		0	IDR	4.788	0	0	0	0,00
	07.2023		0	SGD	1	0	0	0	0,00
	07.2023	ZAR	5	$	0	0	0	0	0,00
	08.2023	DKK	0		0	0	0	0	0,00
	08.2023	IDR	4.790		0	0	0	0	0,00
	08.2023	SGD	1		0	0	0	0	0,00
RYL	07.2023	CAD	0		0	0	0	0	0,00
SCX	07.2023	CHF	4		5	0	0	0	0,00
	07.2023	IDR	4.763		0	0	0	0	0,00
	07.2023	$	1	AUD	1	0	0	0	0,00
	07.2023		81	£	65	2	0	2	0,00
	08.2023	AUD	1	$	1	0	0	0	0,00
SOG	07.2023		1		1	0	0	0	0,00
	07.2023	€	6		6	0	0	0	0,00
	07.2023	HKD	12		2	0	0	0	0,00
	07.2023	$	0	ZAR	9	0	0	0	0,00
	07.2023	ZAR	4	$	0	0	0	0	0,00
	08.2023		9		0	0	0	0	0,00
TOR	07.2023	AUD	1		0	0	0	0	0,00
	07.2023	£	69		88	0	0	0	0,00
	07.2023	¥	59		0	0	0	0	0,00

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung		Zu erhaltende Währung		Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
	07.2023	$	1	AUD	1	$ 0	$ 0	$ 0	0,00
	07.2023		1	CAD	2	0	0	0	0,00
	07.2023		3	¥	438	0	0	0	0,00
	08.2023	AUD	1	$	1	0	0	0	0,00
	08.2023	CAD	2		1	0	0	0	0,00
	08.2023	¥	436		3	0	0	0	0,00
	08.2023	$	88	£	69	0	0	0	0,00
UAG	07.2023		0	AUD	1	0	0	0	0,00
	07.2023		0	CHF	0	0	0	0	0,00
	07.2023		0	ILS	0	0	0	0	0,00
	08.2023	AUD	1	$	0	0	0	0	0,00
	08.2023	CHF	0		0	0	0	0	0,00
	08.2023	ILS	0		0	0	0	0	0,00
						$ 6	$ 0	$ 6	0,00
Summe Freiverkehrsfinanzderivate								**$ 5.932**	**1,28**

LEERVERKAUFTE WERTPAPIERE

BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
US-REGIERUNGSBEHÖRDEN			
Uniform Mortgage-Backed Security, TBA			
2,000 % fällig am 01.08.2053	$ 10.600	$ (8.659)	(1,87)
5,500 % fällig am 01.07.2053 (i)	300	(299)	(0,07)
Summe Leerverkaufte Wertpapiere		**$ (8.958)**	**(1,94)**
Summe Anlagen		**$ 625.880**	**135,49**
Sonstige Aktiva und Passiva		**$ (163.944)**	**(35,49)**
Nettovermögen		**$ 461.936**	**100,00**

ERLÄUTERUNGEN ZUR AUFSTELLUNG DES WERTPAPIERBESTANDS (Angaben in Tausend*):

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

^ **Das Wertpapier ist in Verzug.**

(a) **Bei dem Wertpapier handelt es sich um ein Interest Only- („IO“) bzw. IO-Strip.**

(b) **Wertpapier mit Sachwertausschüttung.**

(c) **Das Wertpapier hat in den letzten zwölf Monaten keine Erträge geliefert.**

(d) **Nullkuponwertpapier.**

(e) **Der Kupon stellt eine Rendite bis zur Endfälligkeit dar.**

(f) **Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.**

(g) **Mit dem Fonds verbunden.**

(h) **Bedingt wandelbares Wertpapier.**

(i) **Zum 30. Juni 2023 leerverkaufter Wertpapier ist durch langfristige Portfolioanlagen in übertragbaren Wertpapieren und Geldmarktinstrumenten abgedeckt.**

(i) **Eingeschränkte Wertpapiere (31. Dezember 2022: 0,64 %):**

Emittentenbeschreibung	Kauf-datum	Kosten	Markt-wert	% des Nettovermögens
Intelsat Emergence S.A.	19.06.2017 - 23.02.2022	$ 5.147	$ 1.260	0,27
Morgan Stanley 0,000 % fällig am 02.04.2032	11.02.2020	613	437	0,09
Neiman Marcus Group Ltd. LLC	25.09.2020	278	1.313	0,28
		$ 6.038	$ 3.010	0,64

Barmittel in Höhe von 10.060 USD (31. Dezember 2022: 10.994 USD) wurden zum 30. Juni 2023 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Barmittel in Höhe von 935 USD (31. Dezember 2022: 376 USD) wurden zum 30. Juni 2023 gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. als Sicherheit für Finanzderivate verpfändet.

Beizulegender Zeitwert[1]

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 30. Juni 2023 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie[2]	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	$ 84.562	$ 505.390	$ 7.057	$ 597.009
Investmentfonds	23.276	0	0	23.276
Pensionsgeschäfte	0	2.001	0	2.001
Finanzderivate[3]	101	12.483	(32)	12.552
Leerverkaufte Wertpapiere	0	(8.958)	0	(8.958)
Summen	**$ 107.939**	**$ 510.916**	**$ 7.025**	**$ 625.880**

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

Kategorie[2]	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	$ 88.708	$ 512.322	$ 9.530	$ 610.560
Investmentfonds	29.661	0	0	29.661
Pensionsgeschäfte	0	781	0	781
Finanzderivate[3]	840	15.599	0	16.439
Leerverkaufte Wertpapiere	0	(13.092)	0	(13.092)
Summen	**$ 119.209**	**$ 515.610**	**$ 9.530**	**$ 644.349**

(1) Weitere Informationen finden Sie in den Erläuterungen in Erläuterung 3.

(2) Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung des Wertpapierbestands.

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

Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC-Finanzderivate und -Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2023 und 31. Dezember 2022:

	Zum 30. Jun. 2023			Zum 31. Dez. 2022		
Kontrahent	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-engagement[1]	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-engagement[1]
BOA	$ 1.849	$ (1.360)	$ 489	$ (103)	$ 0	$ (103)
BOM	k. A.	k. A.	k. A.	(10)	0	(10)
BPS	2.046	(1.790)	256	12	0	12
BRC	(38)	0	(38)	(125)	0	(125)
CBK	(145)	260	115	3.416	(3.380)	36
CLY	(19)	0	(19)	k. A.	k. A.	k. A.
DUB	742	(660)	82	(14)	0	(14)
FAR	(40)	0	(40)	(25)	0	(25)
GLM	(209)	0	(209)	(221)	81	(140)
GST	(154)	261	107	(156)	191	35
HUS	9	0	9	17	0	17
JPM	k. A.	k. A.	k. A.	67	0	67
MBC	(412)	320	(92)	2.861	(2.480)	381
MEI	(7)	0	(7)	(4)	0	(4)
MYC	(35)	94	59	(63)	94	31
MYI	(27)	(40)	(67)	(71)	(96)	(167)
RBC	617	(520)	97	21	0	21
SAL	(51)	0	(51)	(26)	0	(26)
SCX	(18)	0	(18)	3.628	(3.470)	158
SOG	1.678	(1.250)	428	(53)	0	(53)
SSB	115	0	115	11	0	11
TOR	2	0	2	k. A.	k. A.	k. A.
UAG	29	0	29	(41)	10	(31)

(1) Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären.

Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung des Wertpapierbestands zum 30. Juni 2023:

	30. Jun. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	72,54	59,01
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	56,63	59,05
Sonstige übertragbare Wertpapiere	0,08	2,47
Investmentfonds	5,04	5,86
Pensionsgeschäfte	0,43	0,15
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	(0,15)	0,10
Zentral abgerechnete Finanzderivate	1,58	1,34
Freiverkehrsfinanzderivate	1,28	1,80
Leerverkaufte Wertpapiere	(1,94)	(2,58)

Das Anlageportfolio des Fonds konzentriert sich zum 30. Juni 2023 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	30. Jun. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
Kreditbeteiligungen und -abtretung	1,70	1,83
Unternehmensanleihen und Wechsel	11,62	14,21
Kommunalanleihen und Wechsel	0,08	0,08
US-Regierungsbehörden	39,56	31,14
US-Schatzobligationen	18,21	14,89
Non-Agency-MBS	5,95	5,69
Forderungsbesicherte Wertpapiere	17,68	16,75
Staatsemissionen	3,54	4,32
Stammaktien	24,75	24,18
Bezugsrechte	0,01	0,02
Optionsscheine	0,01	0,01
Vorzugswertpapiere	0,56	0,42
Real Estate Investment Trusts	5,44	5,31
Kurzfristige Instrumente	0,14	1,68
Investmentfonds	5,04	5,86
Pensionsgeschäfte	0,43	0,15
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	(0,09)	0,10
Verkaufsoptionen		
Optionen auf börsengehandelte Terminkontrakte	(0,06)	0,00
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	0,00	0,01
Credit Default Swaps auf Kreditindizes— Schutzverkauf	0,13	0,21
Zinsswaps	1,45	1,12
Freiverkehrsfinanzderivate		
Verkaufsoptionen		
Credit Default Swaptions auf Kreditindizes	k. A.	0,00
Zinsswapoptionen	(0,06)	(0,09)
Optionen auf Wertpapiere	0,00	0,00
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	(0,02)	(0,05)
Credit Default Swaps auf Kreditindizes— Schutzverkauf	(0,04)	(0,02)
Total Return Swaps auf Indizes	k. A.	0,00
Devisenterminkontrakte	0,22	0,05
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	1,18	1,91
Leerverkaufte Wertpapiere	(1,94)	(2,58)
Sonstige Aktiva und Passiva	(35,49)	(27,20)
Nettovermögen	100,00	100,00

BESCHREIBUNG		PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
BANKEN UND FINANZEN				
AerCap Ireland Capital DAC				
2,875 % fällig am 14.08.2024	$	4.400	$ 4.230	0,10
AIB Group PLC				
2,250 % fällig am 04.04.2028	€	4.400	4.358	0,10
2,875 % fällig am 30.05.2031		8.800	8.714	0,20
7,583 % fällig am 14.10.2026	$	2.400	2.439	0,06
alstria office REIT-AG				
1,500 % fällig am 23.06.2026	€	6.000	5.276	0,12
Altarea S.C.A.				
1,875 % fällig am 17.01.2028		8.500	7.501	0,17
American Honda Finance Corp.				
5,000 % fällig am 23.05.2025	$	800	797	0,02
American Tower Corp.				
5,250 % fällig am 15.07.2028		2.100	2.077	0,05
Assicurazioni Generali SpA				
2,429 % fällig am 14.07.2031	€	1.800	1.633	0,04
Aviation Capital Group LLC				
4,125 % fällig am 01.08.2025	$	9.080	8.486	0,20
6,250 % fällig am 15.04.2028		100	100	0,00
Banco de Sabadell S.A.				
0,875 % fällig am 16.06.2028	€	6.300	5.773	0,13
Bank of America Corp.				
1,197 % fällig am 24.10.2026	$	15.000	13.503	0,31
Bank of Ireland Group PLC				
0,375 % fällig am 10.05.2027	€	12.300	11.829	0,27
Bank of Montreal				
5,203 % fällig am 01.02.2028	$	5.400	5.401	0,12
Banque Federative du Credit Mutuel S.A.				
6,210 % fällig am 20.07.2023		3.300	3.301	0,08
Barclays PLC				
1,700 % fällig am 03.11.2026	£	5.400	6.033	0,14
2,852 % fällig am 07.05.2026	$	2.400	2.249	0,05
BGC Partners, Inc.				
3,750 % fällig am 01.10.2024		1.195	1.129	0,03
8,000 % fällig am 25.05.2028		4.200	4.062	0,09
BNP Paribas S.A.				
2,219 % fällig am 09.06.2026		10.500	9.716	0,22
CaixaBank S.A.				
0,750 % fällig am 26.05.2028	€	2.100	1.971	0,05
Castellum AB				
0,750 % fällig am 04.09.2026 (h)		9.700	8.718	0,20
2,125 % fällig am 20.11.2023		4.500	4.836	0,11
CBRE Global Investors Open-Ended Fund S.C.A. SICAV-SIF Pan European Core Fund				
0,500 % fällig am 27.01.2028		13.300	11.478	0,26
0,900 % fällig am 12.10.2029		7.600	6.071	0,14
Citigroup, Inc.				
1,250 % fällig am 06.07.2026		5.000	5.106	0,12
3,070 % fällig am 24.02.2028	$	7.400	6.814	0,16
Citycon Treasury BV				
1,625 % fällig am 12.03.2028	€	15.000	11.962	0,28
Clarion Funding PLC				
1,250 % fällig am 13.11.2032	£	2.400	2.072	0,05
Cooperatieve Rabobank UA				
4,655 % fällig am 22.08.2028	$	10.500	10.058	0,23
Corebridge Global Funding				
5,750 % fällig am 02.07.2026 (b)		2.500	2.493	0,06
CPI Property Group S.A.				
1,750 % fällig am 14.01.2030	€	6.100	4.039	0,09
2,750 % fällig am 12.05.2026		27.100	24.066	0,56
2,750 % fällig am 22.01.2028	£	400	341	0,01
CTP NV				
0,500 % fällig am 21.06.2025	€	1.400	1.362	0,03
0,875 % fällig am 20.01.2026		10.200	9.502	0,22
1,500 % fällig am 27.09.2031		4.700	3.579	0,08
Deutsche Bank AG				
1,000 % fällig am 19.11.2025		600	618	0,01
1,625 % fällig am 20.01.2027		7.400	7.180	0,17
1,750 % fällig am 19.11.2030		14.200	12.260	0,28
1,875 % fällig am 23.02.2028		4.000	3.867	0,09
2,625 % fällig am 16.12.2024	£	9.000	10.650	0,25
3,961 % fällig am 26.11.2025	$	6.800	6.487	0,15
Digital Dutch Finco BV				
0,625 % fällig am 15.07.2025	€	4.600	$ 4.565	0,11
1,000 % fällig am 15.01.2032		1.000	772	0,02
Digital Euro Finco LLC				
2,500 % fällig am 16.01.2026		6.100	6.204	0,14
Digital Realty Trust LP				
3,600 % fällig am 01.07.2029	$	2.900	2.579	0,06
EQT AB				
2,375 % fällig am 06.04.2028	€	10.000	9.625	0,22
2,875 % fällig am 06.04.2032		7.400	6.445	0,15
Equitable Financial Life Global Funding				
5,450 % fällig am 03.03.2028	$	4.900	4.833	0,11
Europäische Investitionsbank				
0,750 % fällig am 15.11.2024	£	9.700	11.528	0,27
Federation des Caisses Desjardins du Quebec				
4,400 % fällig am 23.08.2025	$	11.000	10.631	0,25
5,700 % fällig am 14.03.2028		6.600	6.595	0,15
Ford Motor Credit Co. LLC				
1,744 % fällig am 19.07.2024	€	7.600	8.027	0,19
2,748 % fällig am 14.06.2024	£	4.600	5.597	0,13
G City Europe Ltd.				
4,250 % fällig am 11.09.2025	€	11.600	11.073	0,26
Gaci First Investment Co.				
5,125 % fällig am 14.02.2053	$	9.600	8.652	0,20
Globalworth Real Estate Investments Ltd.				
2,950 % fällig am 29.07.2026	€	7.100	5.839	0,13
GLP Capital LP				
4,000 % fällig am 15.01.2030	$	2.600	2.256	0,05
5,300 % fällig am 15.01.2029		2.000	1.906	0,04
Goodman HK Finance				
4,375 % fällig am 19.06.2024		5.045	4.954	0,11
Goodman U.S. Finance Four LLC				
4,500 % fällig am 15.10.2037		6.900	5.764	0,13
GSPA Monetization Trust				
6,422 % fällig am 09.10.2029		9.954	9.523	0,22
Host Hotels & Resorts LP				
4,500 % fällig am 01.02.2026		7.800	7.567	0,17
HSBC Holdings PLC				
7,390 % fällig am 03.11.2028		6.300	6.655	0,15
HSBC USA, Inc.				
5,625 % fällig am 17.03.2025		8.100	8.069	0,19
Indian Railway Finance Corp. Ltd.				
3,835 % fällig am 13.12.2027		3.300	3.083	0,07
ING Groep NV				
1,125 % fällig am 07.12.2028	£	9.100	9.083	0,21
2,125 % fällig am 23.05.2026	€	4.200	4.371	0,10
International Development Association				
0,750 % fällig am 21.09.2028	£	11.000	11.138	0,26
1,750 % fällig am 05.05.2037	€	11.100	10.238	0,24
Intesa Sanpaolo SpA				
0,750 % fällig am 16.03.2028		10.200	9.497	0,22
Jackson National Life Global Funding				
6,242 % fällig am 28.06.2024	$	6.600	6.609	0,15
JPMorgan Chase & Co.				
4,851 % fällig am 25.07.2028		9.700	9.576	0,22
KBC Group NV				
0,250 % fällig am 01.03.2027	€	3.000	2.931	0,07
0,375 % fällig am 16.06.2027		3.200	3.119	0,07
Kojamo Oyj				
0,875 % fällig am 28.05.2029		500	387	0,01
1,875 % fällig am 27.05.2027		2.700	2.449	0,06
Kookmin Bank				
4,500 % fällig am 01.02.2029 (g)	$	7.400	6.951	0,16
LeasePlan Corp. NV				
0,250 % fällig am 23.02.2026	€	15.000	14.678	0,34
Lendlease Finance Ltd.				
3,400 % fällig am 27.10.2027	AUD	24.900	14.552	0,34
3,700 % fällig am 31.03.2031		4.800	2.496	0,06
Lloyds Banking Group PLC				
4,375 % fällig am 22.03.2028	$	1.200	1.139	0,03
Logicor Financing SARL				
1,625 % fällig am 15.07.2027	€	1.100	998	0,02
2,000 % fällig am 17.01.2034		11.600	8.420	0,19
2,250 % fällig am 13.05.2025		2.000	2.031	0,05
3,250 % fällig am 13.11.2028		12.600	11.770	0,27
MassMutual Global Funding				
5,050 % fällig am 07.12.2027	$	7.100	$ 7.095	0,16
Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc.				
1,412 % fällig am 17.07.2025		11.200	10.260	0,24
4,636 % fällig am 07.06.2031	€	1.000	1.100	0,02
5,719 % fällig am 20.02.2026	$	6.600	6.568	0,15
Mizuho Financial Group, Inc.				
0,849 % fällig am 08.09.2024		17.100	16.927	0,39
3,752 % fällig am 19.07.2023	AUD	10.400	6.920	0,16
5,414 % fällig am 13.09.2028	$	8.800	8.737	0,20
6,201 % fällig am 10.07.2024		8.600	8.600	0,20
Morgan Stanley				
5,050 % fällig am 28.01.2027		6.000	5.952	0,14
NatWest Group PLC				
0,750 % fällig am 15.11.2025	€	15.000	15.505	0,36
0,780 % fällig am 26.02.2030		10.000	8.708	0,20
NE Property BV				
1,875 % fällig am 09.10.2026		10.700	10.139	0,23
3,375 % fällig am 14.07.2027 (h)		5.800	5.686	0,13
New Immo Holding S.A.				
2,750 % fällig am 26.11.2026 (h)		8.800	8.610	0,20
Nissan Motor Acceptance Co. LLC				
3,875 % fällig am 21.09.2023	$	3.500	3.481	0,08
Nomura Holdings, Inc.				
2,172 % fällig am 14.07.2028		800	676	0,02
2,679 % fällig am 16.07.2030		7.300	5.979	0,14
5,709 % fällig am 09.01.2026		8.300	8.230	0,19
5,842 % fällig am 18.01.2028		7.500	7.521	0,17
6,181 % fällig am 18.01.2033		4.100	4.234	0,10
NTT Finance Corp.				
4,239 % fällig am 25.07.2025		2.700	2.628	0,06
OneMain Finance Corp.				
6,875 % fällig am 15.03.2025		800	793	0,02
Piper Sandler Cos.				
5,200 % fällig am 15.10.2023		8.500	8.479	0,20
Prologis International Funding S.A.				
1,625 % fällig am 17.06.2032	€	1.000	834	0,02
Reliance Standard Life Global Funding				
3,850 % fällig am 19.09.2023	$	6.950	6.908	0,16
Royal Bank of Canada				
4,900 % fällig am 12.01.2028		4.700	4.640	0,11
Sagax AB				
1,125 % fällig am 30.01.2027	€	11.700	10.773	0,25
Samhallsbyggnadsbolaget i Norden AB				
1,000 % fällig am 12.08.2027 (h)		7.350	5.220	0,12
1,125 % fällig am 04.09.2026 (h)		5.000	3.838	0,09
Santander UK Group Holdings PLC				
2,421 % fällig am 17.01.2029	£	800	828	0,02
SBB Treasury Oyj				
1,125 % fällig am 26.11.2029	€	1.000	641	0,01
Societe Generale S.A.				
1,488 % fällig am 14.12.2026	$	14.100	12.416	0,29
4,677 % fällig am 15.06.2027		6.700	6.461	0,15
6,446 % fällig am 10.01.2029		700	702	0,02
Standard Chartered PLC				
0,800 % fällig am 17.11.2029	€	3.600	3.212	0,07
1,456 % fällig am 14.01.2027	$	15.800	14.018	0,32
7,776 % fällig am 16.11.2025		1.700	1.740	0,04
Starwood Property Trust, Inc.				
3,750 % fällig am 31.12.2024		1.200	1.126	0,03
4,375 % fällig am 15.01.2027		800	690	0,02
Stifel Financial Corp.				
4,000 % fällig am 15.05.2030		12.900	11.025	0,25
Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc.				
5,520 % fällig am 13.01.2028		5.200	5.225	0,12
Tesco Property Finance PLC				
5,744 % fällig am 13.04.2040	£	4.236	4.999	0,12
Toronto-Dominion Bank				
3,879 % fällig am 13.03.2026	€	5.600	6.101	0,14
Toyota Motor Credit Corp.				
5,810 % fällig am 11.12.2023	$	5.500	5.507	0,13
TP ICAP Finance PLC				
7,875 % fällig am 17.04.2030	£	9.800	11.820	0,27
UBS AG				
5,125 % fällig am 15.05.2024 (g)	$	21.200	20.876	0,48
UBS Group AG				
3,750 % fällig am 26.03.2025		3.070	2.940	0,07

BESCHREIBUNG		PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
3,869 % fällig am 12.01.2029	$	12.000	$ 10.859	0,25
5,125 % fällig am 29.07.2026 (e)(g)		1.300	1.135	0,03
5,711 % fällig am 12.01.2027		6.500	6.439	0,15
6,442 % fällig am 11.08.2028		5.650	5.676	0,13
6,537 % fällig am 12.08.2033		13.000	13.325	0,31
7,000 % fällig am 30.09.2027	£	8.800	11.027	0,25
UniCredit SpA				
2,200 % fällig am 22.07.2027	€	5.450	5.495	0,13
7,830 % fällig am 04.12.2023	$	26.900	27.062	0,63
Volkswagen Financial Services NV				
1,125 % fällig am 18.09.2023	£	11.600	14.601	0,34
1,875 % fällig am 03.12.2024		3.800	4.518	0,10
Vonovia SE				
1,375 % fällig am 28.01.2026	€	9.900	9.865	0,23
2,375 % fällig am 25.03.2032		2.100	1.869	0,04
Wells Fargo & Co.				
4,808 % fällig am 25.07.2028	$	9.600	9.392	0,22
Workspace Group PLC				
2,250 % fällig am 11.03.2028	£	7.600	7.085	0,16
Yorkshire Building Society				
3,511 % fällig am 11.10.2030		2.400	2.501	0,06
			985.529	22,78
INDUSTRIEWERTE				
Amdocs Ltd.				
2,538 % fällig am 15.06.2030	$	5.800	4.846	0,11
Amgen, Inc.				
5,150 % fällig am 02.03.2028		4.400	4.399	0,10
5,650 % fällig am 02.03.2053		5.000	5.067	0,12
Babcock International Group PLC				
1,375 % fällig am 13.09.2027	€	8.300	8.023	0,19
Bacardi Ltd.				
4,450 % fällig am 15.05.2025	$	13.000	12.658	0,29
Bayer U.S. Finance LLC				
6,562 % fällig am 15.12.2023		8.000	7.992	0,18
Boardwalk Pipelines LP				
3,400 % fällig am 15.02.2031		7.700	6.633	0,15
Boeing Co.				
2,750 % fällig am 01.02.2026		6.400	5.963	0,14
3,450 % fällig am 01.11.2028		4.200	3.808	0,09
Broadcom, Inc.				
4,150 % fällig am 15.11.2030		2.173	2.000	0,05
4,300 % fällig am 15.11.2032		4.800	4.405	0,10
Canadian Pacific Railway Co.				
3,125 % fällig am 01.06.2026		7.050	6.601	0,15
Centene Corp.				
4,625 % fällig am 15.12.2029		5.000	4.607	0,11
CenterPoint Energy Resources Corp.				
5,250 % fällig am 01.03.2028		6.100	6.102	0,14
Chanel Ceres PLC				
0,500 % fällig am 31.07.2026	€	10.400	10.115	0,23
Charter Communications Operating LLC				
4,908 % fällig am 23.07.2025	$	17.900	17.559	0,41
Cheniere Corpus Christi Holdings LLC				
5,125 % fällig am 30.06.2027		8.700	8.559	0,20
Choice Hotels International, Inc.				
3,700 % fällig am 01.12.2029		1.500	1.295	0,03
CVS Health Corp.				
5,000 % fällig am 30.01.2029		6.000	5.945	0,14
Delta Air Lines Pass-Through Trust				
2,000 % fällig am 10.12.2029		3.036	2.676	0,06
eBay, Inc.				
5,900 % fällig am 22.11.2025		7.700	7.786	0,18
Emory University				
2,143 % fällig am 01.09.2030		10.400	8.744	0,20
Enbridge, Inc.				
5,700 % fällig am 08.03.2033		7.700	7.809	0,18
Energy Transfer LP				
4,500 % fällig am 15.04.2024		5.300	5.240	0,12
Entergy Louisiana LLC				
2,350 % fällig am 15.06.2032		14.000	11.244	0,26
Equifax, Inc.				
5,100 % fällig am 15.12.2027		7.800	7.719	0,18
Expedia Group, Inc.				
3,800 % fällig am 15.02.2028		3.790	3.548	0,08
Global Payments, Inc.				
4,950 % fällig am 15.08.2027	$	7.300	$ 7.119	0,16
Gray Oak Pipeline LLC				
3,450 % fällig am 15.10.2027		12.600	11.272	0,26
HCA, Inc.				
3,125 % fällig am 15.03.2027		9.200	8.454	0,20
5,200 % fällig am 01.06.2028		500	496	0,01
5,500 % fällig am 01.06.2033		900	899	0,02
Hyundai Capital America				
1,000 % fällig am 17.09.2024		9.350	8.797	0,20
5,500 % fällig am 30.03.2026		6.500	6.445	0,15
Imperial Brands Finance PLC				
3,125 % fällig am 26.07.2024		12.000	11.598	0,27
6,125 % fällig am 27.07.2027		5.000	5.013	0,12
Informa PLC				
2,125 % fällig am 06.10.2025	€	15.300	15.928	0,37
Intel Corp.				
5,125 % fällig am 10.02.2030	$	6.900	6.946	0,16
International Business Machines Corp.				
4,000 % fällig am 27.07.2025		5.000	4.889	0,11
International Flavors & Fragrances, Inc.				
2,300 % fällig am 01.11.2030		7.400	5.870	0,14
JSW Hydro Energy Ltd.				
4,125 % fällig am 18.05.2031		2.268	1.916	0,04
Lendlease Europe Finance PLC				
3,500 % fällig am 02.12.2033	£	2.983	2.483	0,06
Marks & Spencer PLC				
3,750 % fällig am 19.05.2026		100	115	0,00
Mercedes-Benz Finance North America LLC				
4,800 % fällig am 30.03.2028	$	9.300	9.186	0,21
Motorola Solutions, Inc.				
2,300 % fällig am 15.11.2030		12.400	10.024	0,23
Mundys SpA				
1,875 % fällig am 12.02.2028	€	26.700	24.908	0,58
NetApp, Inc.				
1,875 % fällig am 22.06.2025	$	2.954	2.746	0,06
2,700 % fällig am 22.06.2030		3.517	2.958	0,07
Nissan Motor Co. Ltd.				
4,345 % fällig am 17.09.2027		2.500	2.276	0,05
4,810 % fällig am 17.09.2030		15.600	13.696	0,32
NXP BV				
3,875 % fällig am 18.06.2026		9.900	9.514	0,22
OCI NV				
6,700 % fällig am 16.03.2033		2.000	1.956	0,05
Oracle Corp.				
4,500 % fällig am 06.05.2028		4.400	4.283	0,10
4,650 % fällig am 06.05.2030		4.400	4.254	0,10
Pearson Funding PLC				
3,750 % fällig am 04.06.2030	£	4.500	4.859	0,11
Rexel S.A.				
2,125 % fällig am 15.12.2028	€	14.200	13.622	0,32
Royalty Pharma PLC				
1,200 % fällig am 02.09.2025	$	3.000	2.707	0,06
Sealed Air Corp.				
1,573 % fällig am 15.10.2026		4.447	3.872	0,09
SEB S.A.				
1,375 % fällig am 16.06.2025	€	5.000	5.160	0,12
Siemens Financieringsmaatschappij NV				
1,200 % fällig am 11.03.2026	$	2.200	1.989	0,05
Southwest Airlines Co.				
5,250 % fällig am 04.05.2025		4.400	4.355	0,10
Sprint Spectrum Co. LLC				
4,738 % fällig am 20.09.2029		1.280	1.263	0,03
T-Mobile USA, Inc.				
4,800 % fällig am 15.07.2028		5.600	5.487	0,13
Thames Water Utilities Finance PLC				
0,875 % fällig am 31.01.2028	€	2.100	1.828	0,04
Tornator Oyj				
1,250 % fällig am 14.10.2026		5.600	5.514	0,13
United Airlines Pass-Through Trust				
2,875 % fällig am 07.04.2030	$	3.121	2.755	0,06
5,800 % fällig am 15.07.2037		4.000	4.072	0,09
Utah Acquisition Sub, Inc.				
3,950 % fällig am 15.06.2026		6.500	6.176	0,14
Venture Global Calcasieu Pass LLC				
6,250 % fällig am 15.01.2030		10.500	10.425	0,24
Venture Global LNG, Inc.				
8,125 % fällig am 01.06.2028	$	3.450	$ 3.508	0,08
8,375 % fällig am 01.06.2031		3.450	3.483	0,08
Volkswagen Group of America Finance LLC				
4,750 % fällig am 13.11.2028		3.000	2.905	0,07
			449.364	10,39
VERSORGUNGSUNTERNEHMEN				
Avangrid, Inc.				
3,800 % fällig am 01.06.2029		2.615	2.386	0,06
Constellation Energy Generation LLC				
5,600 % fällig am 01.03.2028		6.100	6.151	0,14
DTE Energy Co.				
1,050 % fällig am 01.06.2025		2.600	2.383	0,05
Duke Energy Progress LLC				
3,375 % fällig am 01.09.2023		100	100	0,00
Edison International				
3,550 % fällig am 15.11.2024		8.060	7.794	0,18
EDP Finance BV				
1,710 % fällig am 24.01.2028		12.700	10.873	0,25
Electricite de France S.A.				
4,250 % fällig am 25.01.2032	€	3.100	3.349	0,08
Enel Finance International NV				
0,375 % fällig am 28.05.2029		3.400	3.027	0,07
0,875 % fällig am 28.09.2034		9.800	7.517	0,17
1,125 % fällig am 17.10.2034		11.000	8.676	0,20
2,875 % fällig am 11.04.2029	£	10.000	10.564	0,24
Exelon Corp.				
5,150 % fällig am 15.03.2028	$	5.360	5.339	0,12
Florida Power & Light Co.				
5,050 % fällig am 01.04.2028		6.500	6.555	0,15
Ipalco Enterprises, Inc.				
3,700 % fällig am 01.09.2024		5.500	5.320	0,12
National Grid PLC				
5,602 % fällig am 12.06.2028		3.100	3.115	0,07
5,809 % fällig am 12.06.2033		3.300	3.360	0,08
NextEra Energy Capital Holdings, Inc.				
2,200 % fällig am 02.12.2026	AUD	2.000	1.202	0,03
4,900 % fällig am 28.02.2028	$	8.000	7.928	0,18
6,051 % fällig am 01.03.2025		6.400	6.427	0,15
7,677 % fällig am 15.06.2067		791	695	0,02
Oncor Electric Delivery Co. LLC				
4,300 % fällig am 15.05.2028		5.000	4.868	0,11
Pacific Gas & Electric Co.				
2,100 % fällig am 01.08.2027		3.200	2.736	0,06
3,150 % fällig am 01.01.2026		12.500	11.605	0,27
3,300 % fällig am 15.03.2027 ^		2.800	2.544	0,06
3,300 % fällig am 01.12.2027 ^		4.800	4.212	0,10
3,400 % fällig am 15.08.2024 ^		5.700	5.517	0,13
3,500 % fällig am 15.06.2025 ^		3.600	3.410	0,08
4,250 % fällig am 01.08.2023		1.300	1.299	0,03
4,650 % fällig am 01.08.2028		2.400	2.221	0,05
4,750 % fällig am 15.02.2044 ^		1.700	1.321	0,03
5,450 % fällig am 15.06.2027		4.000	3.893	0,09
6,400 % fällig am 15.06.2033		8.700	8.658	0,20
San Diego Gas & Electric Co.				
3,600 % fällig am 01.09.2023		100	100	0,00
Southwest Gas Corp.				
5,450 % fällig am 23.03.2028		5.900	5.887	0,14
Sprint LLC				
7,875 % fällig am 15.09.2023		3.400	3.411	0,08
TDC Net A/S				
5,056 % fällig am 31.05.2028	€	5.100	5.470	0,13
VTR Comunicaciones SpA				
5,125 % fällig am 15.01.2028	$	798	417	0,01
WEC Energy Group, Inc.				
1,375 % fällig am 15.10.2027		5.000	4.274	0,10
			174.604	4,03
Summe Unternehmensanleihen und Wechsel			1.609.497	37,20
KOMMUNALANLEIHEN UND WECHSEL				
JobsOhio Beverage System Revenue Notes, Series 2023				
4,433 % fällig am 01.01.2033		5.350	5.289	0,12
Texas Natural Gas Securitization Finance Corp. Revenue Bonds, Series 2023				
5,102 % fällig am 01.04.2035		6.400	6.430	0,15
Tobacco Settlement Finance Authority, West Virginia Revenue Bonds, Series 2020				
3,301 % fällig am 01.06.2033		7.125	5.882	0,14

BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
University of California Revenue Notes, Series 2020			
0,883 % fällig am 15.05.2025	$ 5.500	$ 5.094	0,12
		22.695	0,53
US-REGIERUNGSBEHÖRDEN			
Fannie Mae			
3,150 % fällig am 01.08.2027	946	894	0,02
3,511 % fällig am 01.12.2034	24	23	0,00
3,522 % fällig am 01.11.2035	27	26	0,00
3,906 % fällig am 01.09.2035	7	7	0,00
3,913 % fällig am 01.09.2035	48	47	0,00
3,951 % fällig am 01.09.2034	8	8	0,00
3,956 % fällig am 01.09.2035	13	13	0,00
4,082 % fällig am 25.05.2035	25	25	0,00
4,204 % fällig am 01.11.2025	0	0	0,00
4,246 % fällig am 01.03.2036	9	9	0,00
4,287 % fällig am 01.04.2033	6	5	0,00
4,323 % fällig am 01.03.2036	9	8	0,00
4,325 % fällig am 01.09.2039	12	11	0,00
4,345 % fällig am 01.05.2038	2.534	2.571	0,06
4,393 % fällig am 01.01.2036	9	8	0,00
4,415 % fällig am 01.11.2034	27	27	0,00
4,521 % fällig am 01.06.2035	208	211	0,00
4,812 % fällig am 25.12.2042	55	52	0,00
4,862 % fällig am 01.07.2035	7	7	0,00
4,944 % fällig am 01.10.2044	13	12	0,00
5,000 % fällig am 25.04.2033 - 25.06.2043	144	141	0,00
5,036 % fällig am 25.07.2037	186	181	0,00
5,094 % fällig am 25.06.2034	263	259	0,01
5,095 % fällig am 01.07.2035	11	11	0,00
5,144 % fällig am 01.10.2040	8	8	0,00
5,258 % fällig am 25.03.2034	3	3	0,00
5,348 % fällig am 01.09.2034	107	108	0,00
5,500 % fällig am 25.09.2042	400	395	0,01
5,524 % fällig am 25.12.2036	38	37	0,00
5,681 % fällig am 01.05.2037	85	83	0,00
5,700 % fällig am 25.09.2041	1.426	1.405	0,03
5,900 % fällig am 25.07.2042	33	33	0,00
6,050 % fällig am 25.04.2032	8	8	0,00
Freddie Mac			
0,650 % fällig am 22.10.2025	83.800	75.935	1,76
0,800 % fällig am 28.10.2026	13.600	11.993	0,28
1,211 % fällig am 15.03.2044	8.024	6.621	0,15
2,000 % fällig am 15.06.2052 (a)	29.144	3.594	0,08
2,750 % fällig am 15.09.2040	266	244	0,01
3,622 % fällig am 01.09.2035	22	22	0,00
4,000 % fällig am 01.10.2029 - 01.10.2047	827	794	0,02
4,051 % fällig am 01.11.2035	28	27	0,00
4,357 % fällig am 01.01.2028	0	0	0,00
4,369 % fällig am 01.09.2028	1	1	0,00
4,485 % fällig am 01.07.2027	1	1	0,00
4,500 % fällig am 01.04.2029 - 01.07.2033	106	104	0,00
4,629 % fällig am 01.07.2030	0	0	0,00
5,176 % fällig am 25.10.2044 - 25.02.2045	65	62	0,00
5,376 % fällig am 25.07.2044	104	97	0,00
5,383 % fällig am 15.10.2043	3.472	3.400	0,08
5,500 % fällig am 01.06.2035 - 01.06.2039	1.840	1.889	0,04
5,693 % fällig am 25.10.2026	3.690	3.677	0,08
6,000 % fällig am 01.10.2027 - 01.05.2040	4.268	4.401	0,10
6,500 % fällig am 15.09.2028	32	33	0,00
Ginnie Mae			
2,625 % fällig am 20.07.2025 - 20.07.2034	40	39	0,00
2,750 % fällig am 20.12.2034	22	22	0,00
2,875 % fällig am 20.04.2030	4	4	0,00
3,000 % fällig am 20.10.2026 - 15.11.2049	887	795	0,02
3,625 % fällig am 20.02.2028 - 20.01.2032	21	20	0,00
4,000 % fällig am 15.02.2052	1.676	1.601	0,04
4,517 % fällig am 20.08.2065	5.019	4.971	0,11
4,575 % fällig am 20.09.2065	8.102	8.019	0,19
4,646 % fällig am 20.11.2067	5.882	5.875	0,14
4,770 % fällig am 20.01.2066	8.366	8.268	0,19
5,000 % fällig am 15.03.2034 - 15.07.2048	980	982	0,02
5,328 % fällig am 20.09.2065	1.156	1.148	0,03
5,566 % fällig am 20.01.2072	$ 4.292	$ 4.184	0,10
5,614 % fällig am 20.08.2062	745	741	0,02
5,616 % fällig am 20.06.2067	2.992	2.989	0,07
5,694 % fällig am 20.08.2065	3.858	3.820	0,09
5,816 % fällig am 20.10.2072	7.015	6.977	0,16
5,866 % fällig am 20.01.2073	7.700	7.623	0,18
5,936 % fällig am 20.01.2073	13.617	13.527	0,31
5,946 % fällig am 20.02.2073	17.565	17.470	0,40
5,966 % fällig am 20.01.2073	26.641	26.532	0,61
6,000 % fällig am 20.09.2038	3	3	0,00
6,086 % fällig am 20.12.2072	5.153	5.166	0,12
6,206 % fällig am 20.11.2072	9.969	10.062	0,23
8,000 % fällig am 20.05.2031	5	5	0,00
Ginnie Mae, TBA			
2,000 % fällig am 01.08.2053	5.500	4.627	0,11
4,000 % fällig am 01.07.2053	11.300	10.779	0,25
5,000 % fällig am 01.07.2053	13.000	12.845	0,30
Small Business Administration			
5,870 % fällig am 01.07.2028	7	7	0,00
6,220 % fällig am 01.12.2028	389	388	0,01
Uniform Mortgage-Backed Security			
3,000 % fällig am 01.03.2028 - 01.07.2052	159.884	141.002	3,26
3,500 % fällig am 01.01.2047 - 01.08.2052	17.407	15.901	0,37
4,000 % fällig am 01.04.2024 - 01.10.2052	27.826	26.686	0,62
4,500 % fällig am 01.07.2023 - 01.05.2053	16.922	16.314	0,38
5,000 % fällig am 01.10.2031 - 01.06.2053	165.311	162.086	3,75
5,500 % fällig am 01.08.2023 - 01.01.2040	2.868	2.917	0,07
6,000 % fällig am 01.05.2024 - 01.02.2041	1.373	1.413	0,03
6,500 % fällig am 01.07.2034 - 01.03.2037	66	68	0,00
Uniform Mortgage-Backed Security, TBA			
3,000 % fällig am 01.07.2053	429.888	378.870	8,77
3,500 % fällig am 01.08.2053	400.500	365.378	8,45
4,000 % fällig am 01.08.2053	232.600	218.490	5,05
4,500 % fällig am 01.07.2038 - 01.08.2053	189.100	181.907	4,20
5,000 % fällig am 01.07.2053	279.300	273.732	6,33
5,500 % fällig am 01.08.2053	126.400	125.778	2,91
		2.189.562	50,62
US-SCHATZOBLIGATIONEN			
U.S. Treasury Bonds			
1,375 % fällig am 15.11.2040	163.600	109.586	2,53
1,375 % fällig am 15.08.2050	24.100	14.018	0,32
1,625 % fällig am 15.11.2050	35.800	22.253	0,51
1,750 % fällig am 15.08.2041	19.500	13.714	0,32
1,875 % fällig am 15.02.2041	2.400	1.745	0,04
2,000 % fällig am 15.02.2050	21.700	14.888	0,34
2,250 % fällig am 15.08.2049	6.400	4.654	0,11
2,500 % fällig am 15.02.2045	6.100	4.726	0,11
2,875 % fällig am 15.08.2045	5.200	4.294	0,10
2,875 % fällig am 15.05.2049	7.500	6.205	0,14
3,000 % fällig am 15.05.2042	2.900	2.494	0,06
3,000 % fällig am 15.11.2044	138.800	117.538	2,72
3,000 % fällig am 15.02.2049	8.100	6.855	0,16
3,125 % fällig am 15.11.2041	15.300	13.482	0,31
3,125 % fällig am 15.02.2043	5.600	4.887	0,11
3,125 % fällig am 15.08.2044	23.500	20.348	0,47
3,250 % fällig am 15.05.2042	22.800	20.357	0,47
3,375 % fällig am 15.08.2042	30.400	27.608	0,64
3,375 % fällig am 15.05.2044	47.300	42.670	0,99
3,625 % fällig am 15.02.2044	24.700	23.155	0,53
3,750 % fällig am 15.08.2041	18.600	17.975	0,42
3,750 % fällig am 15.11.2043	5.000	4.781	0,11
3,875 % fällig am 15.05.2043	12.400	12.102	0,28
4,000 % fällig am 15.11.2042	13.425	13.345	0,31
4,000 % fällig am 15.11.2052	43.900	45.107	1,04
4,375 % fällig am 15.11.2039	10.100	10.705	0,25
U.S. Treasury Inflation Protected Securities (d)			
0,125 % fällig am 15.10.2024	40.077	38.661	0,89
0,125 % fällig am 15.07.2031	17.994	15.964	0,37
0,125 % fällig am 15.01.2032	13.896	12.240	0,28
0,125 % fällig am 15.02.2051	3.612	2.413	0,06
0,250 % fällig am 15.02.2050	8.022	5.618	0,13
0,500 % fällig am 15.04.2024	$ 10.343	$ 10.093	0,23
0,625 % fällig am 15.01.2024	69.936	68.754	1,59
0,625 % fällig am 15.07.2032	16.285	14.977	0,35
0,625 % fällig am 15.02.2043	132	108	0,00
0,750 % fällig am 15.02.2045	25.632	21.206	0,49
0,875 % fällig am 15.02.2047	8.167	6.860	0,16
1,000 % fällig am 15.02.2046	768	667	0,02
1,000 % fällig am 15.02.2049	2.652	2.283	0,05
1,250 % fällig am 15.04.2028 (i)	13.955	13.508	0,31
1,375 % fällig am 15.02.2044	781	736	0,02
1,500 % fällig am 15.02.2053	9.285	9.024	0,21
U.S. Treasury Notes			
1,750 % fällig am 30.06.2024	16.700	16.108	0,37
		818.712	18,92
NON-AGENCY-MBS			
American Home Mortgage Investment Trust			
5,510 % fällig am 25.12.2046	123	104	0,00
Angel Oak Mortgage Trust			
1,469 % fällig am 25.06.2065	1.062	978	0,02
Ashford Hospitality Trust			
6,319 % fällig am 15.06.2035	10.151	9.889	0,23
Atrium Hotel Portfolio Trust			
6,393 % fällig am 15.06.2035	6.900	6.751	0,16
Banc of America Funding Trust			
3,616 % fällig am 20.09.2035 ^	837	659	0,02
4,381 % fällig am 25.05.2035	1.329	1.237	0,03
Banc of America Merrill Linch Trust			
3,218 % fällig am 14.04.2033	5.500	5.112	0,12
Banc of America Merrill Lynch Commercial Mortgage, Inc.			
4,231 % fällig am 15.09.2060	10.900	10.285	0,24
Banc of America Mortgage Trust			
4,370 % fällig am 25.07.2035 ^	197	181	0,00
5,268 % fällig am 25.07.2034	146	131	0,00
BankUnited Trust			
5,750 % fällig am 25.09.2045	747	680	0,02
Barclays Commercial Mortgage Securities Trust			
4,314 % fällig am 15.12.2051	8.000	7.540	0,17
Bear Stearns Adjustable Rate Mortgage Trust			
2,785 % fällig am 25.11.2030	2	2	0,00
3,709 % fällig am 25.04.2034	197	165	0,00
3,766 % fällig am 25.04.2034	174	156	0,00
4,027 % fällig am 25.04.2034	89	82	0,00
4,201 % fällig am 25.01.2034	151	147	0,00
4,439 % fällig am 25.02.2034	63	58	0,00
4,513 % fällig am 25.04.2033	12	12	0,00
4,752 % fällig am 25.07.2034	6	5	0,00
5,552 % fällig am 25.12.2035	83	80	0,00
Bear Stearns ALT-A Trust			
4,195 % fällig am 25.05.2035	377	356	0,01
4,202 % fällig am 25.09.2035 ^	413	257	0,01
5,470 % fällig am 25.02.2034	43	38	0,00
Benchmark Mortgage Trust			
3,666 % fällig am 15.01.2051	11.100	10.158	0,23
3,965 % fällig am 10.04.2051	6.084	5.788	0,13
Citigroup Commercial Mortgage Trust			
3,251 % fällig am 10.05.2035	8.002	7.435	0,17
Citigroup Mortgage Loan Trust			
3,974 % fällig am 25.09.2037 ^	96	84	0,00
5,410 % fällig am 25.10.2035	34	31	0,00
Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.			
6,080 % fällig am 25.09.2035	899	904	0,02
Commercial Mortgage Trust			
3,144 % fällig am 10.03.2048	3.277	3.197	0,07
3,545 % fällig am 10.02.2036	11.300	10.270	0,24
3,590 % fällig am 10.11.2047	12.200	11.734	0,27
Countrywide Alternative Loan Trust			
5,500 % fällig am 25.02.2036	2.934	2.332	0,05
5,500 % fällig am 25.05.2036 ^	1.871	1.561	0,04
5,750 % fällig am 25.02.2037	3.271	1.815	0,04
6,000 % fällig am 25.02.2036	4.773	2.995	0,07
6,000 % fällig am 25.04.2036 ^	193	100	0,00
6,000 % fällig am 25.08.2036 ^	5.142	3.184	0,07
6,000 % fällig am 25.08.2036	842	778	0,02
6,000 % fällig am 25.11.2036 ^	260	144	0,00
6,000 % fällig am 25.08.2037 ^	3.855	2.335	0,05
6,610 % fällig am 25.11.2035	6.881	6.321	0,15

BESCHREIBUNG		PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust				
3,810 % fällig am 25.11.2034	$	373	$ 339	0,01
3,833 % fällig am 20.10.2035		1.420	1.366	0,03
3,864 % fällig am 20.02.2035		92	92	0,00
4,125 % fällig am 19.07.2031		0	0	0,00
5,550 % fällig am 25.04.2046		809	758	0,02
5,910 % fällig am 20.02.2036 ^		50	42	0,00
6,000 % fällig am 25.07.2037 ^		250	124	0,00
Countrywide Home Loan Reperforming REMIC Trust				
4,237 % fällig am 25.01.2034 ^		15	12	0,00
5,490 % fällig am 25.06.2035		118	108	0,00
6,500 % fällig am 25.11.2034 ^		24	22	0,00
Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp.				
4,311 % fällig am 25.06.2033		3	3	0,00
Credit Suisse First Boston Mortgage-Backed Pass-Through Certificates				
6,000 % fällig am 25.11.2035 ^		2.322	673	0,02
Credit Suisse Mortgage Capital Certificates				
3,387 % fällig am 26.04.2038		733	708	0,02
Credit Suisse Mortgage Capital Mortgage-Backed Trust				
5,750 % fällig am 25.04.2036 ^		762	424	0,01
6,000 % fällig am 25.05.2036 ^		1.869	1.101	0,03
6,000 % fällig am 25.04.2037 ^		562	222	0,01
CSAIL Commercial Mortgage Trust				
3,458 % fällig am 15.11.2050		4.600	4.150	0,10
Deutsche ALT-A Securities Mortgage Loan Trust				
5,480 % fällig am 25.08.2037 ^		2.519	2.137	0,05
Downey Savings & Loan Association Mortgage Loan Trust				
5,235 % fällig am 19.07.2044		10	9	0,00
Eurohome UK Mortgages PLC				
5,137 % fällig am 15.06.2044	£	1.732	2.116	0,05
First Horizon Alternative Mortgage Securities Trust				
5,376 % fällig am 25.10.2034	$	81	78	0,00
6,000 % fällig am 25.06.2037		1.139	446	0,01
GS Mortgage Securities Corp. Trust				
6,110 % fällig am 15.07.2025		3.810	3.756	0,09
GSR Mortgage Loan Trust				
3,935 % fällig am 25.01.2036 ^		1.286	1.259	0,03
4,070 % fällig am 25.09.2035		1.513	1.432	0,03
4,234 % fällig am 25.06.2034		53	50	0,00
4,485 % fällig am 25.06.2034		23	20	0,00
5,500 % fällig am 25.01.2037 ^		10	19	0,00
HarborView Mortgage Loan Trust				
5,417 % fällig am 19.03.2037		3.172	2.853	0,07
5,597 % fällig am 19.05.2035		159	146	0,00
IndyMac Adjustable Rate Mortgage Trust				
3,544 % fällig am 25.01.2032		0	0	0,00
IndyMac Mortgage Loan Trust				
5,630 % fällig am 25.06.2037		1.008	902	0,02
JPMBB Commercial Mortgage Securities Trust				
3,358 % fällig am 15.11.2048		9.403	9.028	0,21
JPMDB Commercial Mortgage Securities Trust				
2,994 % fällig am 15.12.2049		8.260	7.757	0,18
JPMorgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust				
6,403 % fällig am 15.06.2035		10.951	10.173	0,23
JPMorgan Mortgage Trust				
4,186 % fällig am 25.07.2035		123	115	0,00
5,750 % fällig am 25.01.2036 ^		336	166	0,00
Landmark Mortgage Securities PLC				
4,865 % fällig am 17.04.2044	£	6.712	8.258	0,19
Lehman XS Trust				
5,510 % fällig am 25.12.2036	$	3.911	3.793	0,09
5,550 % fällig am 25.03.2047		10.696	9.156	0,21
London Wall Mortgage Capital PLC				
5,502 % fällig am 15.05.2052	£	1.357	1.712	0,04
MASTR Adjustable Rate Mortgages Trust				
3,857 % fällig am 25.01.2036	$	9	8	0,00
4,560 % fällig am 21.11.2034		1.693	1.601	0,04
MASTR Reperforming Loan Trust				
7,000 % fällig am 25.05.2035		533	385	0,01
Merrill Lynch Mortgage Investors Trust				
4,159 % fällig am 25.02.2035		691	652	0,02
4,391 % fällig am 25.06.2035		293	277	0,01
5,650 % fällig am 25.11.2035		220	207	0,00
Metlife Securitization Trust				
3,750 % fällig am 25.03.2057		6.326	5.928	0,14
Mortgage Equity Conversion Asset Trust				
5,790 % fällig am 25.05.2042	$	3.756	$ 3.513	0,08
MortgageIT Trust				
5,710 % fällig am 25.10.2035		650	635	0,01
NAAC Reperforming Loan REMIC Trust				
7,000 % fällig am 25.10.2034 ^		447	398	0,01
7,500 % fällig am 25.03.2034 ^		578	507	0,01
NAAC Reperforming Loan REMIC Trust Certificates				
6,500 % fällig am 25.02.2035 ^		1.898	1.701	0,04
New Residential Mortgage Loan Trust				
3,500 % fällig am 25.12.2057		5.717	5.363	0,12
Nomura Asset Acceptance Corp. Alternative Loan Trust				
6,220 % fällig am 25.02.2035		416	409	0,01
Paragon Mortgages PLC				
3,563 % fällig am 15.11.2038	€	573	605	0,01
Precise Mortgage Funding PLC				
0,000 % fällig am 12.12.2055 (c)	£	0	1.993	0,05
Prime Mortgage Trust				
5,550 % fällig am 25.02.2034	$	65	60	0,00
Primrose Residential DAC				
4,189 % fällig am 24.03.2061	€	12.699	13.760	0,32
Residential Accredit Loans, Inc. Trust				
5,550 % fällig am 25.05.2037 ^	$	2.429	1.715	0,04
6,000 % fällig am 25.04.2036		2.576	2.073	0,05
Residential Asset Securitization Trust				
6,000 % fällig am 25.01.2037 ^		2.511	906	0,02
6,500 % fällig am 25.09.2036 ^		706	253	0,01
Residential Funding Mortgage Securities, Inc. Trust				
5,398 % fällig am 25.02.2036 ^		122	100	0,00
Resloc UK PLC				
5,161 % fällig am 15.12.2043	£	3.635	4.451	0,10
Ripon Mortgages PLC				
5,491 % fällig am 28.08.2056		13.463	17.055	0,39
RMAC Securities PLC				
5,414 % fällig am 12.06.2044		768	919	0,02
Stratton Mortgage Funding PLC				
5,391 % fällig am 20.07.2060		15.165	19.282	0,45
Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust				
3,392 % fällig am 25.02.2036 ^	$	1.013	921	0,02
5,133 % fällig am 25.04.2034		1.330	1.310	0,03
5,227 % fällig am 25.09.2034		227	213	0,00
Structured Asset Mortgage Investments Trust				
5,370 % fällig am 25.09.2047		10.478	8.742	0,20
5,626 % fällig am 19.04.2035		264	239	0,01
5,646 % fällig am 19.07.2035		184	176	0,00
5,710 % fällig am 25.02.2036 ^		432	364	0,01
5,726 % fällig am 19.05.2034		165	150	0,00
5,806 % fällig am 19.09.2032		18	18	0,00
6,000 % fällig am 25.05.2047		7.411	6.074	0,14
Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust				
7,500 % fällig am 25.10.2036 ^		648	390	0,01
Structured Asset Securities Corp. Mortgage Pass-Through Certificates				
6,639 % fällig am 25.06.2033		2	2	0,00
Thornburg Mortgage Securities Trust				
3,114 % fällig am 25.09.2037		2.622	2.547	0,06
7,151 % fällig am 25.06.2047 ^		1.954	1.653	0,04
Towd Point Mortgage Funding PLC				
5,635 % fällig am 20.10.2051	£	10.086	12.841	0,30
5,841 % fällig am 20.07.2045		18.688	23.769	0,55
Tower Bridge Funding PLC				
5,527 % fällig am 20.11.2063		5.687	7.192	0,17
Trinity Square PLC				
5,316 % fällig am 15.07.2059		10.514	13.348	0,31
Tudor Rose Mortgages				
5,509 % fällig am 20.06.2048		523	661	0,02
Twin Bridges PLC				
6,115 % fällig am 12.12.2054		2.904	3.699	0,09
Uropa Securities PLC				
4,729 % fällig am 10.10.2040		526	653	0,02
WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust				
3,307 % fällig am 25.01.2037 ^	$	3.873	3.404	0,08
3,715 % fällig am 25.09.2036 ^		1.023	908	0,02
3,753 % fällig am 25.02.2037 ^		645	590	0,01
5,690 % fällig am 25.07.2045		319	303	0,01
5,730 % fällig am 25.10.2045		3.107	2.935	0,07
5,770 % fällig am 25.01.2045		131	129	0,00
5,790 % fällig am 25.01.2045	$	1.603	$ 1.524	0,04
Warwick Finance Residential Mortgages PLC				
0,000 % fällig am 21.12.2049 (c)	£	0	1.651	0,04
5,865 % fällig am 21.12.2049		9.369	11.855	0,27
6,564 % fällig am 21.12.2049		2.030	2.556	0,06
7,064 % fällig am 21.12.2049		1.015	1.271	0,03
7,564 % fällig am 21.12.2049		580	724	0,02
8,064 % fällig am 21.12.2049		580	712	0,02
Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates Trust				
5,500 % fällig am 25.05.2035 ^	$	540	426	0,01
6,000 % fällig am 25.11.2035 ^		470	383	0,01
Washington Mutual MSC Mortgage Pass-Through Certificates Trust				
3,770 % fällig am 25.02.2031		1	1	0,00
			390.686	9,03

FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE

BESCHREIBUNG		PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
ACE Securities Corp. Home Equity Loan Trust				
5,270 % fällig am 25.10.2036		229	87	0,00
5,470 % fällig am 25.08.2036 ^		6.265	1.594	0,04
Ameriquest Mortgage Securities Trust				
5,735 % fällig am 25.03.2036		50	50	0,00
Ameriquest Mortgage Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates				
5,855 % fällig am 25.01.2036		1.139	1.133	0,03
6,080 % fällig am 25.05.2035		3.517	3.452	0,08
6,170 % fällig am 25.10.2034		1.135	1.119	0,03
6,260 % fällig am 25.03.2035		4.705	4.582	0,11
Armada Euro CLO DAC				
3,897 % fällig am 15.07.2031	€	11.995	12.802	0,30
Asset-Backed Funding Certificates Trust				
5,850 % fällig am 25.06.2034	$	92	90	0,00
Asset-Backed Securities Corp. Home Equity Loan Trust				
3,688 % fällig am 25.12.2036		2.231	2.148	0,05
Atlas Senior Loan Fund Ltd.				
6,410 % fällig am 16.01.2030		11.252	11.198	0,26
Avoca CLO DAC				
3,867 % fällig am 15.07.2030	€	11.476	12.315	0,28
3,997 % fällig am 15.10.2032		5.200	5.546	0,13
Barings CLO Ltd.				
6,210 % fällig am 15.04.2031	$	13.100	12.937	0,30
Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust				
4,807 % fällig am 25.05.2035		119	119	0,00
4,842 % fällig am 25.12.2035		1.114	1.101	0,03
6,350 % fällig am 25.01.2045		124	122	0,00
Black Diamond CLO DAC				
4,303 % fällig am 15.05.2032	€	12.000	12.809	0,30
Blackrock European CLO DAC				
3,797 % fällig am 15.10.2031		13.000	13.858	0,32
BlueMountain CLO Ltd.				
6,453 % fällig am 22.10.2030	$	962	957	0,02
BlueMountain Fuji EUR CLO DAC				
3,827 % fällig am 15.07.2030	€	1.797	1.925	0,04
BNPP AM Euro CLO DAC				
4,031 % fällig am 22.07.2032		12.000	12.793	0,30
Bosphorus CLO DAC				
4,346 % fällig am 15.12.2030		240	258	0,01
Bridgepoint CLO DAC				
4,387 % fällig am 15.01.2034		1.000	1.076	0,03
Cairn CLO DAC				
3,842 % fällig am 30.04.2031		12.813	13.699	0,32
4,212 % fällig am 20.10.2028		107	116	0,00
Carlyle Euro CLO DAC				
3,953 % fällig am 15.08.2030		8.829	9.417	0,22
Carrington Mortgage Loan Trust				
6,140 % fällig am 25.06.2035	$	847	825	0,02
CIFC Funding Ltd.				
6,440 % fällig am 16.11.2030		1.320	1.315	0,03
CIT Mortgage Loan Trust				
6,500 % fällig am 25.10.2037		759	758	0,02
Citigroup Mortgage Loan Trust				
5,470 % fällig am 25.09.2036		4.533	3.312	0,08
Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.				
5,400 % fällig am 25.03.2037		1.839	1.517	0,04
Commonbond Student Loan Trust				
6,000 % fällig am 25.05.2041		546	537	0,01

BESCHREIBUNG		PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
Countrywide Asset-Backed Certificates Trust				
5,290 % fällig am 25.06.2047 ^	$	1.677	$ 1.495	0,03
5,370 % fällig am 25.09.2037 ^		1.148	1.152	0,03
5,380 % fällig am 25.07.2037 ^		1.000	834	0,02
Countrywide Asset-Backed Certificates Trust, Inc.				
6,005 % fällig am 25.08.2034		190	189	0,00
6,050 % fällig am 25.10.2034		844	814	0,02
Credit-Based Asset Servicing & Securitization LLC				
5,448 % fällig am 25.05.2046		1.716	1.454	0,03
Credit-Based Asset Servicing & Securitization Trust				
5,270 % fällig am 25.11.2036		116	55	0,00
CVC Cordatus Loan Fund DAC				
4,156 % fällig am 15.09.2031	€	12.997	13.876	0,32
FBR Securitization Trust				
5,855 % fällig am 25.11.2035	$	4.533	4.413	0,10
First Franklin Mortgage Loan Trust				
5,260 % fällig am 25.12.2037		4.022	3.773	0,09
5,825 % fällig am 25.03.2034		365	350	0,01
6,080 % fällig am 25.07.2034		82	81	0,00
6,425 % fällig am 25.07.2034		586	570	0,01
GE-WMC Mortgage Securities Trust				
5,230 % fällig am 25.08.2036		34	14	0,00
Griffith Park CLO DAC				
4,103 % fällig am 21.11.2031	€	12.000	12.845	0,30
GSAMP Trust				
5,290 % fällig am 25.12.2036	$	12.064	6.527	0,15
5,390 % fällig am 25.01.2037		416	243	0,01
Harvest CLO DAC				
4,027 % fällig am 15.01.2032	€	13.700	14.626	0,34
Home Equity Asset Trust				
5,750 % fällig am 25.07.2036	$	4.678	4.246	0,10
6,185 % fällig am 25.08.2035		133	129	0,00
HSI Asset Securitization Corp. Trust				
5,690 % fällig am 25.12.2035		1.475	1.456	0,03
JPMorgan Mortgage Acquisition Trust				
5,585 % fällig am 25.05.2036		3.873	3.632	0,08
Jubilee CLO DAC				
3,787 % fällig am 15.04.2030	€	20.000	21.382	0,49
LCM LP				
6,290 % fällig am 20.10.2027	$	803	804	0,02
Madison Park Euro Funding DAC				
3,927 % fällig am 15.01.2032	€	12.300	13.138	0,30
Man GLG Euro CLO DAC				
4,216 % fällig am 15.12.2031		11.089	11.879	0,27
Massachusetts Educational Financing Authority				
6,205 % fällig am 25.04.2038	$	5	5	0,00
Merrill Lynch First Franklin Mortgage Loan Trust				
6,400 % fällig am 25.10.2037		9.380	7.761	0,18
MF1 LLC				
7,226 % fällig am 19.06.2037		11.300	11.268	0,26
Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust				
5,330 % fällig am 25.05.2037		544	474	0,01
5,350 % fällig am 25.09.2036		952	357	0,01
5,380 % fällig am 25.11.2036		941	519	0,01
5,450 % fällig am 25.07.2036	$	7.716	$ 2.960	0,07
5,470 % fällig am 25.09.2036		7.694	3.443	0,08
5,855 % fällig am 25.01.2035		1.476	1.391	0,03
New Century Home Equity Loan Trust				
5,510 % fällig am 25.05.2036		47	46	0,00
5,870 % fällig am 25.10.2035		3.668	3.505	0,08
OZLM Ltd.				
6,340 % fällig am 17.04.2031		10.246	10.105	0,23
6,549 % fällig am 30.10.2030		8.671	8.639	0,20
Palmer Square European Loan Funding DAC				
3,897 % fällig am 15.10.2031	€	10.977	11.737	0,27
Palmerston Park CLO DAC				
3,825 % fällig am 18.04.2030		5.565	5.993	0,14
Purple Finance CLO DAC				
4,061 % fällig am 25.01.2031		731	790	0,02
Renaissance Home Equity Loan Trust				
6,350 % fällig am 25.11.2034	$	153	126	0,00
Securitized Asset-Backed Receivables LLC Trust				
5,390 % fällig am 25.11.2036		5.865	1.708	0,04
5,430 % fällig am 25.05.2036		440	237	0,01
Starwood Commercial Mortgage Trust				
6,296 % fällig am 15.07.2038		7.449	7.386	0,17
Structured Asset Investment Loan Trust				
5,530 % fällig am 25.03.2036		529	512	0,01
5,915 % fällig am 25.08.2035		480	455	0,01
Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust				
5,305 % fällig am 25.09.2036		7.194	4.524	0,10
Venture CLO Ltd.				
6,350 % fällig am 20.01.2029		16.485	16.370	0,38
WaMu Asset-Backed Certificates WaMu Trust				
5,510 % fällig am 25.04.2037		4.948	1.888	0,04
Wells Fargo Home Equity Asset-Backed Securities Trust				
6,150 % fällig am 25.10.2034		1.054	1.035	0,02
			368.778	8,52

STAATSEMISSIONEN

BESCHREIBUNG		PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
Action Logement Services				
0,500 % fällig am 30.10.2034	€	7.600	6.038	0,14
Airport Authority Hong Kong				
4,750 % fällig am 12.01.2028	$	1.300	1.297	0,03
4,875 % fällig am 12.01.2030		5.000	5.085	0,12
Canada Government International Bond				
2,250 % fällig am 01.12.2029	CAD	38.600	27.268	0,63
Development Bank of Japan, Inc.				
0,010 % fällig am 15.10.2024	€	6.600	6.840	0,16
0,875 % fällig am 10.10.2025		4.300	4.386	0,10
Europäische Union				
0,000 % fällig am 04.10.2028 (c)		1.678	1.559	0,04
Hungary Government International Bond				
1,750 % fällig am 05.06.2035		10.000	7.665	0,18
Israel Government International Bond				
3,800 % fällig am 13.05.2060	$	1.000	762	0,02
4,125 % fällig am 17.01.2048		1.000	858	0,02
Japan Finance Organization for Municipalities				
0,010 % fällig am 02.02.2028	€	9.900	$ 9.195	0,21
Ministeries van de Vlaamse Gemeenschap				
0,875 % fällig am 21.03.2046		10.000	6.363	0,15
Paraguay Government International Bond				
4,950 % fällig am 28.04.2031	$	2.300	2.215	0,05
Peru Government International Bond				
6,350 % fällig am 12.08.2028	PEN	25.000	6.998	0,16
Poland Government International Bond				
5,500 % fällig am 04.04.2053	$	4.000	4.036	0,09
Province of Ontario				
1,850 % fällig am 01.02.2027	CAD	7.000	4.878	0,11
Romania Government International Bond				
3,000 % fällig am 27.02.2027	$	12.000	10.892	0,25
United Kingdom Gilt				
0,875 % fällig am 31.07.2033	£	1.300	1.185	0,03
			107.520	2,49

KURZFRISTIGE INSTRUMENTE

COMMERCIAL PAPER

BESCHREIBUNG		PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
AT+T, Inc.				
5,700 % fällig am 19.03.2024	$	11.000	10.530	0,24
National Grid Holdings Ltd.				
5,450 % fällig am 13.07.2023		5.150	5.140	0,12
VW Credit, Inc.				
5,400 % fällig am 25.07.2023		9.150	9.116	0,21
Walgreens Boots Alliance				
6,000 % fällig am 06.07.2023		1.800	1.798	0,04
Summe kurzfristige Instrumente			26.584	0,61
Summe Übertragbare Wertpapiere			**$ 5.534.034**	**127,92**

INVESTMENTFONDS

ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN

	AKTIEN		
PIMCO Funds: Global Investors Series plc - US Short-Term Fund (f)	9.560.426	95.987	2,22
PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (f)	16.473.452	164.042	3,79
Summe Investmentfonds		**$ 260.029**	**6,01**

PENSIONSGESCHÄFTE

Kontrahent	Kredit-zins	Abrechnungs-datum	Fälligkeits-datum	Kapital-betrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensions-geschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensions-geschäft[1]	% des Nettovermögens
FICC	2,400 %	30.06.2023	03.07.2023	$ 1.321	U.S. Treasury Notes 4,625 % fällig am 30.06.2025	$ (1.347)	$ 1.321	$ 1.321	0,03
Summe Pensionsgeschäfte						**$ (1.347)**	**$ 1.321**	**$ 1.321**	**0,03**

[1] Umfasst aufgelaufene Zinsen.

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

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

FUTURES

Beschreibung	Art	Ablauf-monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Euro-Bobl September Futures	Short	09.2023	1.506	$ 2.774	0,06
Euro-BTP Italy Government Bond September Futures	Short	09.2023	582	(638)	(0,01)

Beschreibung	Art	Ablauf-monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Euro-Bund 10-Year Bond September Futures	Short	09.2023	1.393	$ 1.823	0,04
Euro-Buxl 30-Year Bond September Futures	Short	09.2023	107	(223)	(0,01)
Euro-OAT France Government 10-Year Bond September Futures	Short	09.2023	676	746	0,02
Japan Government 10-Year Bond September Futures	Short	09.2023	137	(446)	(0,01)
U.S. Treasury 2-Year Note September Futures	Long	09.2023	976	(2.332)	(0,05)
U.S. Treasury 5-Year Note September Futures	Long	09.2023	1.624	(3.028)	(0,07)
U.S. Treasury 10-Year Note September Futures	Long	09.2023	667	(647)	(0,01)
U.S. Treasury 10-Year Ultra September Futures	Short	09.2023	1.455	1.491	0,03
U.S. Treasury 30-Year Bond September Futures	Long	09.2023	175	111	0,00
				$ (369)	(0,01)

VERKAUFSOPTIONEN

OPTIONEN AUF BÖRSENGEHANDELTE TERMINKONTRAKTE

Beschreibung	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Anzahl der Kontrakte	Aufgeld	Markt-wert	% des Nettovermögens
Put - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note August Futures	$ 111,500	21.07.2023	103	$ (45)	$ (39)	0,00
Call - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note August Futures	115,500	21.07.2023	103	(36)	(5)	0,00
Put - CBOT U.S. Treasury 30-Year Bond August Futures	123,000	21.07.2023	30	(12)	(4)	0,00
Call - CBOT U.S. Treasury 30-Year Bond August Futures	131,000	21.07.2023	30	(15)	(6)	0,00
Call - CME-Kaufoptionen mit Ausübungskurs bei 98,000 USD auf 3-Month SOFR December Futures	98,000	15.12.2023	70	(57)	(3)	0,00
Put - CME-Verkaufsoptionen mit Ausübungskurs bei 96,500 USD auf 3-Month SOFR December Futures	96,500	15.12.2023	70	(65)	(331)	(0,01)
				$ (230)	$ (388)	(0,01)
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate					**$ (757)**	**(0,02)**

ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)

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

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMMISSIONEN - SCHUTZVERKAUF[1]

Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag[3]	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
AT&T, Inc.	1,000 %	20.12.2023	$ 7.300	$ (72)	0,00
AT&T, Inc.	1,000	20.06.2024	12.400	56	0,00
Barclays Bank PLC	1,000	20.12.2023	€ 3.900	0	0,00
Boeing Co.	1,000	20.12.2025	$ 4.600	115	0,00
Boeing Co.	1,000	20.12.2027	4.600	231	0,01
General Electric Co.	1,000	20.12.2023	8.300	430	0,01
General Electric Co.	1,000	20.06.2024	4.700	38	0,00
General Electric Co.	1,000	20.12.2024	5.500	129	0,00
Rolls-Royce PLC	1,000	20.06.2025	€ 14.500	2.511	0,06
Ryder System, Inc.	1,000	20.12.2023	$ 1.500	29	0,00
T-Mobile USA, Inc.	5,000	20.06.2028	6.700	23	0,00
Verizon Communications, Inc.	1,000	20.12.2027	500	8	0,00
Verizon Communications, Inc.	1,000	20.06.2028	6.200	11	0,00
				$ 3.509	0,08

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZKAUF[2]

Index/Tranchen	Zu bezahlender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag[3]	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
CDX.HY-35 5-Year Index	(5,000) %	20.12.2025	$ 9.408	$ 252	0,01
CDX.HY-36 5-Year Index	(5,000)	20.06.2026	5.292	255	0,01
CDX.HY-38 5-Year Index	(5,000)	20.06.2027	97.118	(6.436)	(0,16)
				$ (5.929)	(0,14)

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES - SCHUTZVERKAUF[1]

Index/Tranchen	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag[3]	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
CDX.IG-39 5-Year Index	1,000 %	20.12.2027	$ 4.100	$ 34	0,00

ZINSSWAPS

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Erhalt	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	0,900 %	15.03.2052	£ 8.400	$ 4.562	0,10
Erhalt[4]	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	3,250	20.09.2053	5.400	488	0,01
Erhalt[4]	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	3,500	20.09.2033	24.300	1.764	0,04
Zahlung	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,062	18.09.2026	¥ 3.550.000	(217)	(0,01)
Zahlung	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,063	19.09.2026	7.000	0	0,00

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits-datum		Nenn-betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Zahlung	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,064 %	19.09.2026	¥	877.000	$ (55)	0,00
Zahlung	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,380	18.06.2028		5.170.000	(117)	0,00
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,500	15.03.2042		4.651.000	1.091	0,02
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,662	19.04.2042		260.000	86	0,00
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,705	31.10.2038		1.180.000	128	0,00
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,750	20.03.2038		436.000	(6)	0,00
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,750	20.12.2038		1.947.000	222	0,01
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,785	12.11.2038		600.000	54	0,00
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,800	22.10.2038		400.000	29	0,00
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,800	15.06.2052		4.070.000	1.685	0,04
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,730	24.02.2032	$	14.800	(2.144)	(0,05)
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,750	21.12.2052		65.900	5.006	0,11
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,765	16.03.2032		45.000	(6.309)	(0,15)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,943	21.04.2032		14.800	(1.817)	(0,04)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,150	15.06.2027		88.100	(5.975)	(0,14)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,680	11.07.2032		31.600	(2.138)	(0,05)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,690	11.07.2032		31.600	(2.104)	(0,05)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,050	08.09.2029		6.800	(293)	(0,01)
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,050	14.12.2052		9.570	408	0,01
Erhalt[4]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,156	10.03.2033		77.900	(50)	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,300	06.03.2033		5.100	(121)	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,340	23.02.2030		7.100	(176)	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,370	01.03.2033		6.100	(103)	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,400	23.02.2033		4.100	(61)	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,405	01.03.2033		4.800	(68)	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,425	01.03.2033		4.800	(62)	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,430	27.02.2033		6.300	(78)	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,450	07.03.2033		9.400	(102)	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,470	22.02.2030		8.600	(144)	0,00
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,525	02.03.2030		3.300	(46)	0,00
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,750	21.06.2025		101.600	356	0,01
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,800	10.03.2028		8.900	(74)	0,00
Zahlung	3-Month CAD-CAONREPO Compounded-OIS	4,000	21.06.2025	CAD	227.500	115	0,00
Zahlung	3-Month NZD-BBR	3,750	15.06.2027	NZD	39.100	(457)	(0,01)
Zahlung	3-Month NZD-BBR	4,000	14.06.2024		115.900	(863)	(0,02)
Zahlung	3-Month NZD-BBR	4,250	21.12.2027		3.300	(44)	0,00
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	0,550	10.08.2024	€	4.000	(179)	0,00
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	0,650	12.04.2027		25.000	(2.655)	(0,06)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	1,000	13.05.2027		21.000	(1.969)	(0,05)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	1,580	24.05.2024		239.500	(5.682)	(0,13)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,547	09.03.2033		7.400	(164)	0,00
Zahlung[4]	6-Month EUR-EURIBOR	3,000	20.09.2033		132.600	1.152	0,03
						$ (17.127)	(0,39)
Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate						**$ (19.513)**	**(0,45)**

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

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

(3) Der maximal mögliche Betrag, den der Fonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

(4) Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft.

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

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

OPTIONSKAUF

ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag[1]	Kosten	Markt-wert	% des Nettovermögens
BOA	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,750 %	12.09.2023	124.000	$ 992	$ 1.798	0,04
FAR	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,750	11.09.2023	116.900	877	1.692	0,04
							$ 1.869	$ 3.490	0,08

VERKAUFSOPTIONEN

ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag[1]	Aufgeld	Markt-wert	% des Nettovermögens
BOA	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,250 %	12.09.2023	124.000	$ (620)	$ (1.229)	(0,03)
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,750	12.09.2023	124.000	(372)	(702)	(0,02)
	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	2,150	01.12.2023	68.600	(213)	(7)	0,00
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,650	01.12.2023	68.600	(213)	(928)	(0,02)
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,380	31.07.2023	4.700	(18)	(22)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,780	31.07.2023	4.700	(18)	(14)	0,00
	Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,070	10.07.2023	3.200	(21)	(8)	0,00
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,370	10.07.2023	3.200	(21)	(2)	0,00
	Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,060	14.07.2023	1.800	(13)	(8)	0,00
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,360	14.07.2023	1.800	(13)	(4)	0,00
BPS	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,200	06.07.2023	2.200	(7)	0	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,650	06.07.2023	2.200	(7)	(2)	0,00
	Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,000	03.07.2023	1.800	(12)	0	0,00
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,400	03.07.2023	1.800	(12)	0	0,00
BRC	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,260	26.07.2023	1.800	(6)	(4)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,660	26.07.2023	1.800	(6)	(9)	0,00
	Call - OTC 7-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,350	27.07.2023	2.200	(5)	(4)	0,00
	Put - OTC 7-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,850	27.07.2023	2.200	(5)	(8)	0,00
FAR	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,233	11.09.2023	116.900	(550)	(1.175)	(0,03)
	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,715	11.09.2023	116.900	(328)	(693)	(0,01)
	Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,000	03.07.2023	1.900	(13)	0	0,00
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,400	03.07.2023	1.900	(13)	0	0,00
GLM	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,260	26.07.2023	1.800	(6)	(4)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,660	26.07.2023	1.800	(6)	(9)	0,00
	Call - OTC 7-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,350	27.07.2023	2.200	(5)	(4)	0,00
	Put - OTC 7-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,850	27.07.2023	2.200	(5)	(8)	0,00
JPM	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,300	10.07.2023	2.300	(8)	(1)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,750	10.07.2023	2.300	(8)	(1)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,250	20.07.2023	5.000	(17)	(6)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,650	20.07.2023	5.000	(17)	(21)	0,00
MYC	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	4,715	11.09.2023	116.700	(327)	(692)	(0,02)
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,200	06.07.2023	2.200	(7)	0	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,650	06.07.2023	2.200	(7)	(2)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,300	10.07.2023	2.200	(8)	(1)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,750	10.07.2023	2.200	(8)	(1)	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,270	24.07.2023	2.200	(7)	(4)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,670	24.07.2023	2.200	(7)	(9)	0,00
							$ (2.929)	$ (5.582)	(0,13)

[1] Der Nennbetrag stellt die Anzahl der Kontrakte dar.

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMMISSIONEN - SCHUTZVERKAUF[1]

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag[2]	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Markt-wert	% des Nettovermögens
BPS	Colombia Government International Bond	1,000 %	20.06.2027	$ 1.600	$ (77)	$ 28	$ (49)	0,00
	Colombia Government International Bond	1,000	20.12.2027	400	(36)	18	(18)	0,00
BRC	Colombia Government International Bond	1,000	20.12.2026	2.325	(108)	60	(48)	0,00
CBK	Colombia Government International Bond	1,000	20.06.2027	700	(25)	4	(21)	0,00
GST	Colombia Government International Bond	1,000	20.06.2027	3.000	(112)	20	(92)	0,00
	Colombia Government International Bond	1,000	20.12.2027	1.300	(116)	58	(58)	0,00
JPM	Colombia Government International Bond	1,000	20.12.2026	2.275	(104)	57	(47)	0,00
	Colombia Government International Bond	1,000	20.06.2027	400	(15)	3	(12)	0,00
	South Africa Government International Bond	1,000	20.12.2023	100	(5)	5	0	0,00
MYC	Colombia Government International Bond	1,000	20.06.2027	2.900	(104)	16	(88)	0,00
	Colombia Government International Bond	1,000	20.12.2027	3.400	(302)	153	(149)	(0,01)
					$ (1.004)	$ 422	$ (582)	(0,01)

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

[2] Der maximal mögliche Betrag, den der Fonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
AZD	07.2023	AUD 2.441	$ 1.620	$ 0	$ (5)	$ (5)	0,00
	07.2023	$ 299	AUD 457	5	0	5	0,00
	08.2023	1.621	2.441	5	0	5	0,00
BOA	07.2023	CAD 45.106	$ 33.150	0	(938)	(938)	(0,02)
	07.2023	€ 3.182	3.477	6	0	6	0,00
	07.2023	NZD 916	556	0	(5)	(5)	0,00
	07.2023	$ 2.400	AUD 3.676	47	0	47	0,00

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung		Zu erhaltende Währung		Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
	07.2023	$	7.584	€	7.049	$ 107	$ 0	$ 107	0,00
	07.2023		668	PEN	2.448	7	0	7	0,00
	08.2023	¥	627.100	$	4.391	24	0	24	0,00
	09.2023	HKD	18.102		2.317	3	0	3	0,00
	09.2023	TWD	110.762		3.649	85	0	85	0,00
	09.2023	$	9.930	IDR	148.646.905	0	(57)	(57)	0,00
	09.2023		8.593	INR	710.712	46	0	46	0,00
BPS	07.2023	AUD	1.745	$	1.156	0	(6)	(6)	0,00
	07.2023	CHF	96		106	0	(1)	(1)	0,00
	07.2023	CZK	2.815		131	2	0	2	0,00
	07.2023	€	3.892		4.243	0	(3)	(3)	0,00
	07.2023	$	102	CHF	92	0	0	0	0,00
	07.2023		2.085	€	1.917	7	0	7	0,00
	08.2023	CHF	91	$	102	0	0	0	0,00
	08.2023	TWD	55.440		1.816	35	0	35	0,00
	08.2023	$	1.157	AUD	1.745	6	0	6	0,00
	09.2023	THB	48	$	1	0	0	0	0,00
	09.2023	$	289	PEN	1.056	1	0	1	0,00
	12.2023		142	INR	11.717	0	0	0	0,00
BRC	08.2023		992	¥	131.337	0	(78)	(78)	0,00
	09.2023		91	ILS	324	0	(3)	(3)	0,00
	09.2023		211	PEN	772	1	0	1	0,00
	12.2023		1.531	INR	126.372	0	(1)	(1)	0,00
BSH	07.2023		2.252	PEN	8.291	34	0	34	0,00
CBK	07.2023	CZK	2.484	$	115	1	0	1	0,00
	07.2023	£	300		381	0	0	0	0,00
	07.2023	$	1.035	AUD	1.587	21	0	21	0,00
	07.2023		18.265	CLP	14.781.571	142	0	142	0,00
	07.2023		17.692	€	16.407	218	(9)	209	0,01
	07.2023		1.293	£	1.012	0	(6)	(6)	0,00
	07.2023		3.100	PEN	11.352	29	0	29	0,00
	08.2023	CNH	296	$	42	2	0	2	0,00
	08.2023	TWD	57.719		1.891	37	0	37	0,00
	08.2023	$	442	PEN	1.728	33	0	33	0,00
DUB	07.2023		8.852	£	7.100	174	0	174	0,00
	09.2023		100	PEN	367	1	0	1	0,00
FAR	07.2023		29	CLP	22.678	0	0	0	0,00
GLM	07.2023	PEN	8.298	$	2.267	0	(21)	(21)	0,00
	07.2023	$	896	PEN	3.271	5	0	5	0,00
	09.2023		4.073		14.937	23	0	23	0,00
	09.2023		12.262	TWD	373.183	0	(255)	(255)	(0,01)
JPM	07.2023	€	13.846	$	14.803	0	(302)	(302)	(0,01)
	07.2023	$	2.308	AUD	3.531	42	0	42	0,00
	07.2023		761.149	€	697.087	0	(627)	(627)	(0,01)
	08.2023	€	697.087	$	762.214	651	0	651	0,02
	08.2023	$	162	¥	21.584	0	(12)	(12)	0,00
	09.2023	IDR	240.583	$	16	0	0	0	0,00
	09.2023	INR	4.664		57	0	0	0	0,00
	09.2023	PEN	77.395		21.020	0	(204)	(204)	0,00
	09.2023	$	4.133	IDR	62.180.258	0	(2)	(2)	0,00
	09.2023		88	ILS	311	0	(4)	(4)	0,00
	09.2023		14	PEN	50	0	0	0	0,00
	09.2023		8.110	THB	278.124	0	(207)	(207)	0,00
	12.2023		9.131	INR	753.530	0	(3)	(3)	0,00
MBC	07.2023	€	5.136	$	5.493	0	(110)	(110)	0,00
	07.2023	£	255.628		316.433	0	(8.562)	(8.562)	(0,20)
	07.2023	$	9.850	€	9.131	112	0	112	0,00
MYI	07.2023	£	35	$	44	0	0	0	0,00
	07.2023	IDR	39.185.115		2.620	7	0	7	0,00
	07.2023	$	5	CHF	4	0	0	0	0,00
	07.2023		607	€	557	0	0	0	0,00
	07.2023		1.574	£	1.264	33	0	33	0,00
	07.2023		2.608	IDR	39.185.115	6	0	6	0,00
	08.2023	TWD	59.657	$	1.967	51	0	51	0,00
	08.2023	$	14.152	¥	1.880.695	0	(1.057)	(1.057)	(0,02)
	08.2023		31	TWD	960	0	(1)	(1)	0,00
	09.2023	INR	1.007	$	12	0	0	0	0,00
	09.2023	$	2.620	IDR	39.219.177	0	(15)	(15)	0,00
	09.2023		3.703	THB	126.775	0	(100)	(100)	0,00
RBC	08.2023	MXN	2.245	$	130	0	0	0	0,00
SCX	07.2023	AUD	3.585		2.380	0	(7)	(7)	0,00
	07.2023	NZD	2.385		1.448	0	(13)	(13)	0,00
	07.2023	$	3.257	AUD	4.984	61	0	61	0,00
	07.2023		1.048	£	834	12	0	12	0,00
	08.2023	CNH	204	$	30	2	0	2	0,00
	08.2023	$	2.382	AUD	3.585	6	0	6	0,00
	09.2023	IDR	238.245.988	$	16.023	197	0	197	0,00
	09.2023	INR	2.917		35	0	0	0	0,00
	09.2023	TWD	92.552		3.036	58	0	58	0,00
	09.2023	$	1.553	PEN	5.720	16	0	16	0,00
	09.2023		8.335	THB	287.811	0	(156)	(156)	0,00
SOG	07.2023	€	705.535	$	758.972	0	(10.768)	(10.768)	(0,25)
	07.2023	$	1.974	AUD	3.017	34	0	34	0,00

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung		Zu erhaltende Währung		Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
SSB	08.2023	CLP	14.774.113	$	18.222	$ 0	$ (131)	$ (131)	0,00
TOR	07.2023	AUD	4.412		2.914	0	(23)	(23)	0,00
	07.2023	$	1.044	AUD	1.597	19	0	19	0,00
	07.2023		34.091	CAD	45.109	24	(25)	(1)	0,00
	07.2023		312.404	£	245.852	160	0	160	0,00
	07.2023		2.010	NZD	3.301	12	0	12	0,00
	08.2023	CAD	45.091	$	34.091	24	(23)	1	0,00
	08.2023	£	245.852		312.472	0	(154)	(154)	0,00
	08.2023	NZD	3.301		2.010	0	(12)	(12)	0,00
	08.2023	$	2.916	AUD	4.412	23	0	23	0,00
	08.2023		6.532	¥	866.175	0	(501)	(501)	(0,01)
UAG	07.2023	AUD	7.031	$	4.695	25	(10)	15	0,00
	07.2023	$	239	AUD	365	4	0	4	0,00
	08.2023		4.699		7.031	9	(24)	(15)	0,00
	09.2023	SGD	22.211	$	16.619	160	0	160	0,00
	09.2023	$	75	ILS	269	0	(2)	(2)	0,00
	09.2023		8.133	INR	672.355	40	0	40	0,00
						$ 2.895	$ (24.443)	$ (21.548)	(0,50)

ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklasse Institutional CAD (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung		Zu erhaltende Währung		Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2023	CAD	363	$	271	$ 0	$ (3)	$ (3)	0,00
	07.2023	$	2.556	CAD	3.479	72	0	72	0,01
CBK	07.2023		161		219	5	0	5	0,00
JPM	07.2023		2.542		3.449	64	0	64	0,00
MBC	07.2023	CAD	689	$	518	0	(3)	(3)	0,00
	07.2023	$	58	CAD	78	1	0	1	0,00
MYI	07.2023	CAD	60	$	45	0	0	0	0,00
SCX	07.2023	$	2.557	CAD	3.473	67	0	67	0,00
TOR	07.2023	CAD	5.678	$	4.285	2	(7)	(5)	0,00
	08.2023	$	4.285	CAD	5.675	8	(2)	6	0,00
						$ 219	$ (15)	$ 204	0,01

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklassen Institutional CHF (Hedged) thesaurierend, Investor CHF (Hedged) thesaurierend und Class E CHF (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung		Zu erhaltende Währung		Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BPS	07.2023	CHF	5.627	$	6.291	$ 2	$ 0	$ 2	0,00
	07.2023	$	8.407	CHF	7.605	93	0	93	0,00
	08.2023		6.291		5.611	0	(2)	(2)	0,00
CLY	07.2023	CHF	2.974	$	3.311	0	(13)	(13)	0,00
	08.2023	$	3.311	CHF	2.965	13	0	13	0,00
JPM	07.2023		107		97	1	0	1	0,00
MBC	07.2023	CHF	72	$	81	0	0	0	0,00
	07.2023	$	373	CHF	336	2	0	2	0,00
MYI	07.2023	CHF	188	$	208	0	(2)	(2)	0,00
	07.2023	$	109	CHF	99	1	0	1	0,00
RYL	07.2023	CHF	9	$	10	0	0	0	0,00
SCX	07.2023	$	5.878	CHF	5.282	26	0	26	0,00
UAG	07.2023	CHF	5.827	$	6.501	0	(13)	(13)	0,00
	07.2023	$	5.297	CHF	4.759	23	0	23	0,00
	08.2023		6.501		5.811	13	0	13	0,00
						$ 174	$ (30)	$ 144	0,00

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklassen Institutional EUR (Hedged) thesaurierend, Institutional EUR (Hedged) ausschüttend, Investor EUR (Hedged) thesaurierend, Administrative EUR (Hedged) thesaurierend, Class E EUR (Hedged) thesaurierend, Class E EUR (Hedged) ausschüttend, Class R EUR (Hedged) thesaurierend und Class T EUR (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung		Zu erhaltende Währung		Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2023	€	1.393	$	1.520	$ 2	$ (3)	$ (1)	0,00
	07.2023	$	404.146	€	376.053	6.127	0	6.127	0,14
BPS	07.2023	€	381.416	$	417.909	1.786	(2)	1.784	0,04
	07.2023	$	404.314	€	376.103	6.014	0	6.014	0,14
	08.2023		416.017		379.148	0	(1.798)	(1.798)	(0,04)
CBK	07.2023	€	409.338	$	444.652	2	(1.937)	(1.935)	(0,04)
	07.2023	$	10.133	€	9.339	56	0	56	0,00
	08.2023		413.798		380.073	1.429	0	1.429	0,03
JPM	07.2023	€	380.073	$	415.001	342	0	342	0,01
	07.2023	$	31.065	€	29.056	634	0	634	0,01
	08.2023		415.582		380.073	0	(354)	(354)	(0,01)
MBC	07.2023	€	7.352	$	7.895	0	(126)	(126)	0,00
	07.2023	$	14.430	€	13.489	287	(1)	286	0,01
SOG	07.2023		404.589		376.103	5.740	0	5.740	0,13
						$ 22.419	$ (4.221)	$ 18.198	0,42

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklassen Institutional GBP (Hedged) thesaurierend und Institutional GBP (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2023	$ 50	£ 40	$ 0	$ 0	$ 0	0,00
BPS	07.2023	10.762	8.698	298	(1)	297	0,01
BRC	07.2023	£ 181	$ 226	0	(5)	(5)	0,00
	07.2023	$ 173	£ 137	1	0	1	0,00
CBK	07.2023	£ 21	$ 26	0	0	0	0,00
	07.2023	$ 646	£ 511	4	(1)	3	0,00
JPM	07.2023	£ 8.727	$ 11.034	0	(61)	(61)	(0,01)
	08.2023	$ 11.037	£ 8.727	61	0	61	0,00
MBC	07.2023	£ 10	$ 13	0	0	0	0,00
	07.2023	$ 10.716	£ 8.656	289	0	289	0,01
MYI	07.2023	10.591	8.521	243	0	243	0,01
TOR	07.2023	£ 8.730	$ 11.094	0	(6)	(6)	0,00
	08.2023	$ 11.096	£ 8.730	5	0	5	0,00
				$ 901	$ (74)	$ 827	0,02

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklassen Institutional SGD (Hedged) thesaurierend, SGD (Hedged) ausschüttend und Class E SGD (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BRC	07.2023	$ 9.164	SGD 12.400	$ 0	$ (2)	$ (2)	0,00
GLM	07.2023	SGD 1.009	$ 751	5	0	5	0,00
	07.2023	$ 386	SGD 520	0	(2)	(2)	0,00
JPM	07.2023	SGD 12.126	$ 8.961	1	0	1	0,00
	07.2023	$ 1.543	SGD 2.088	0	0	0	0,00
	08.2023	8.961	12.114	0	(1)	(1)	0,00
MBC	07.2023	SGD 26	$ 20	0	0	0	0,00
	07.2023	$ 8.327	SGD 11.250	0	(14)	(14)	0,00
MYI	07.2023	SGD 11.725	$ 8.678	14	0	14	0,00
	08.2023	$ 8.678	SGD 11.715	0	(13)	(13)	0,00
UAG	07.2023	SGD 228	$ 169	1	0	1	0,00
	07.2023	$ 9.030	SGD 12.215	0	(4)	(4)	0,00
				$ 21	$ (36)	$ (15)	0,00
Summe Freiverkehrsfinanzderivate						**$ (4.864)**	**(0,11)**

LEERVERKAUFTE WERTPAPIERE

BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖGENS
US-REGIERUNGSBEHÖRDEN			
Uniform Mortgage-Backed Security, TBA			
2,000 % fällig am 01.08.2053	$ 32.300	$ (26.386)	(0,61)
2,500 % fällig am 01.08.2053	49.700	(42.214)	(0,98)
Summe Leerverkaufte Wertpapiere		**$ (68.600)**	**(1,59)**
Summe Anlagen		**$ 5.701.650**	**131,79**
Sonstige Aktiva und Passiva		**$ (1.375.281)**	**(31,79)**
Nettovermögen		**$ 4.326.369**	**100,00**

ERLÄUTERUNGEN ZUR AUFSTELLUNG DES WERTPAPIERBESTANDS (Angaben in Tausend*):

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

^ **Das Wertpapier ist in Verzug.**

(a) **Bei dem Wertpapier handelt es sich um ein Interest Only- („IO“) bzw. IO-Strip.**

(b) **Wertpapier per Emissionstermin.**

(c) **Nullkuponwertpapier.**

(d) **Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.**

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

(f) **Mit dem Fonds verbunden.**

(g) **Bedingt wandelbares Wertpapier.**

(h) **Wertpapiere mit einem gesamten beizulegenden Zeitwert von 9.570 USD (31. Dezember 2022: 1.858 USD) wurden zum 30. Juni 2023 gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte als Sicherheit verpfändet.**

(i) **Wertpapier mit einem gesamten beizulegenden Zeitwert von 7.928 USD (31. Dezember 2022: 25.953 USD) wurde zum 30. Juni 2023 gemäß den Rahmenverträgen für Wertpapier-Termingeschäfte für verzögert gelieferte Wertpapiere oder Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte als Sicherheit verpfändet oder geliefert.**

Barmittel in Höhe von 320 USD (31. Dezember 2022: null USD) wurden zum 30. Juni 2023 gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte als Sicherheit geliefert.

Barmittel in Höhe von 76.292 USD (31. Dezember 2022: 94.783 USD) wurden zum 30. Juni 2023 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Barmittel in Höhe von 12.000 USD (31. Dezember 2022: 13.885 USD) wurden zum 30. Juni 2023 gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. als Sicherheit für Finanzderivate verpfändet.

Beizulegender Zeitwert[1]

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 30. Juni 2023 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie[2]	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	$ 0	$ 5.532.045	$ 1.989	$ 5.534.034
Investmentfonds	260.029	0	0	260.029
Pensionsgeschäfte	0	1.321	0	1.321
Finanzderivate[3]	4.036	(29.170)	0	(25.134)
Leerverkaufte Wertpapiere	0	(68.600)	0	(68.600)
Summen	**$ 264.065**	**$ 5.435.596**	**$ 1.989**	**$ 5.701.650**

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

	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	$ 0	$ 4.765.456	$ 5.405	$ 4.770.861
Investmentfonds	292.421	0	0	292.421
Pensionsgeschäfte	0	170.895	0	170.895
Finanzderivate[3]	39.217	(35.072)	0	4.145
Leerverkaufte Wertpapiere	0	(68.457)	0	(68.457)
Summen	**$ 331.638**	**$ 4.832.822**	**$ 5.405**	**$ 5.169.865**

(1) Weitere Informationen finden Sie in den Erläuterungen in Erläuterung 3.

(2) Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung des Wertpapierbestands.

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

Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2023:

Kontrahent	Kredit-zins	Abrechnungs-datum	Fälligkeits-datum	Kredit-betrag	Verbindlichkeiten aus umgekehrten Pensions-geschäften	% des Nettovermögens
BRC	0,000 %	21.06.2023	TBD[1]	€ (2.919)	$ (3.185)	(0,07)
	1,000	13.06.2023	TBD[1]	(3.006)	(3.284)	(0,08)
	2,000	10.05.2023	TBD[1]	(449)	(491)	(0,01)
	2,850	10.05.2023	TBD[1]	(1.232)	(1.349)	(0,03)
MYI	1,500	10.05.2023	TBD[1]	(1.004)	(1.098)	(0,03)
Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte					**$ (9.407)**	**(0,22)**

(1) Umgekehrtes Pensionsgeschäft mit offener Laufzeit.

Ausstehende Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte zum 30. Juni 2023:

Kontrahent	Kredit-zins	Abrechnungs-datum	Fälligkeits-datum	Kredit-betrag	Zahlbar für Rückkauf-Finanzierungs-geschäfte[1]	% des Nettovermögens
BPG	5,080 %	28.06.2023	05.07.2023	$ (7.978)	$ (7.982)	(0,18)
Summe Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte					**$ (7.982)**	**(0,18)**

(1) In dem für Rückkaufgeschäfte zahlbaren Betrag sind 5 USD für einen aufgeschobenen Kursrückgang enthalten.

Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC-Finanzderivate und -Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2023 und 31. Dezember 2022:

	Zum 30. Jun. 2023			Zum 31. Dez. 2022		
Kontrahent	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-engagement[1]	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-engagement[1]
AZD	$ 5	$ (10)	$ (5)	$ (27)	$ 0	$ (27)
BOA	4.394	(2.980)	1.414	(167)	280	113
BPS	6.362	(5.480)	882	1.927	(1.740)	187
BRC	(160)	0	(160)	(182)	20	(162)
BSH	34	0	34	k. A.	k. A.	k. A.
CBK	5	0	5	8.777	(8.710)	67
CLY	k. A.	k. A.	k. A.	4	0	4
DUB	175	0	175	374	(270)	104
FAR	(176)	0	(176)	1	0	1
GLM	(270)	0	(270)	(710)	600	(110)
GST	(150)	260	110	(273)	260	(13)
JPM	(69)	0	(69)	(176)	0	(176)
MBC	(8.125)	5.980	(2.145)	6.728	(6.220)	508

Kontrahent	Zum 30. Jun. 2023 Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-engagement[1]	Zum 31. Dez. 2022 Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-engagement[1]
MYC	$ (946)	$ 790	$ (156)	$ (550)	$ 470	$ (80)
MYI	(833)	960	127	(406)	270	(136)
RBC	k. A.	k. A.	k. A.	(4)	0	(4)
RYL	k. A.	k. A.	k. A.	1	0	1
SAL	k. A.	k. A.	k. A.	(68)	0	(68)
SCX	269	(290)	(21)	(11.948)	11.385	(563)
SOG	(4.994)	3.690	(1.304)	(34)	0	(34)
SSB	(131)	50	(81)	k. A.	k. A.	k. A.
TOR	(476)	270	(206)	(2)	600	598
UAG	222	(210)	12	62	0	62

[1] Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären.

Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung des Wertpapierbestands zum 30. Juni 2023:

	30. Jun. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	59,27	66,92
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	68,65	47,33
Sonstige übertragbare Wertpapiere	k. A.	0,68
Investmentfonds	6,01	7,05
Pensionsgeschäfte	0,03	4,12
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	(0,02)	0,86
Zentral abgerechnete Finanzderivate	(0,45)	(0,84)
Freiverkehrsfinanzderivate	(0,11)	0,08
Leerverkaufte Wertpapiere	(1,59)	(1,65)
Umgekehrte Pensionsgeschäfte	(0,22)	(0,04)
Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte	(0,18)	(1,85)

Das Anlageportfolio des Fonds konzentriert sich zum 30. Juni 2023 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	30. Jun. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
Unternehmensanleihen und Wechsel	37,20	36,37
Kommunalanleihen und Wechsel	0,53	0,28
US-Regierungsbehörden	50,62	37,34
US-Schatzobligationen	18,92	17,09
Non-Agency-MBS	9,03	9,41
Forderungsbesicherte Wertpapiere	8,52	9,66
Staatsemissionen	2,49	2,46
Kurzfristige Instrumente	0,61	2,32
Investmentfonds	6,01	7,05
Pensionsgeschäfte	0,03	4,12
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	(0,01)	0,87
Verkaufsoptionen		
Optionen auf börsengehandelte Terminkontrakte	(0,01)	(0,01)
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen - Schutzkauf	k. A.	0,00
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	0,08	0,07
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzkauf	(0,14)	(0,12)
Credit Default Swaps auf Kreditindizes— Schutzverkauf	0,00	k. A.
Zinsswaps	(0,39)	(0,79)
Freiverkehrsfinanzderivate		
Optionskauf		
Zinsswapoptionen	0,08	0,07
Verkaufsoptionen		
Credit Default Swaptions auf Kreditindizes	k. A.	0,00
Zinsswapoptionen	(0,13)	(0,11)
Optionen auf Wertpapiere	k. A.	0,00
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	(0,01)	(0,03)
Devisenterminkontrakte	(0,50)	(0,57)
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	0,45	0,72
Leerverkaufte Wertpapiere	(1,59)	(1,65)
Sonstige Aktiva und Passiva	(31,79)	(24,55)
Nettovermögen	100,00	100,00

Aufstellung des Wertpapierbestands des PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund

BESCHREIBUNG		PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
BANKEN UND FINANZEN				
AerCap Ireland Capital DAC				
3,150 % fällig am 15.02.2024	$	1.550	$ 1.521	0,50
American Express Co.				
5,801 % fällig am 03.05.2024		1.400	1.402	0,46
American Tower Corp.				
5,000 % fällig am 15.02.2024		500	497	0,16
Aozora Bank Ltd.				
1,050 % fällig am 09.09.2024		1.800	1.689	0,56
5,900 % fällig am 02.03.2026		2.000	1.999	0,66
Athene Global Funding				
0,950 % fällig am 08.01.2024		2.500	2.426	0,80
1,200 % fällig am 13.10.2023		1.100	1.083	0,36
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A.				
0,875 % fällig am 18.09.2023		3.600	3.563	1,18
Banco Santander S.A.				
3,892 % fällig am 24.05.2024		1.200	1.177	0,39
Bank of America Corp.				
0,810 % fällig am 24.10.2024		500	492	0,16
3,864 % fällig am 23.07.2024		200	200	0,07
5,501 % fällig am 14.06.2024		1.100	1.099	0,36
5,749 % fällig am 04.02.2025		1.000	999	0,33
Bank of Montreal				
5,329 % fällig am 09.07.2024		3.435	3.424	1,13
5,800 % fällig am 08.03.2024		500	500	0,17
5,800 % fällig am 12.12.2024		800	800	0,26
Bank of Nova Scotia				
6,050 % fällig am 11.03.2024		500	502	0,17
BNP Paribas S.A.				
3,800 % fällig am 10.01.2024		2.833	2.797	0,93
4,705 % fällig am 10.01.2025		700	694	0,23
BPCE S.A.				
4,000 % fällig am 12.09.2023		1.500	1.493	0,49
4,000 % fällig am 15.04.2024		1.000	984	0,33
Capital One Financial Corp.				
6,439 % fällig am 09.05.2025		2.400	2.373	0,79
CK Hutchison International Ltd.				
3,250 % fällig am 11.04.2024		1.000	982	0,32
CNH Industrial Capital LLC				
1,950 % fällig am 02.07.2023		1.800	1.800	0,60
4,200 % fällig am 15.01.2024		1.000	990	0,33
Cooperatieve Rabobank UA				
4,029 % fällig am 19.04.2024	AUD	500	332	0,11
5,320 % fällig am 12.01.2024	$	1.000	1.000	0,33
Danske Bank A/S				
5,375 % fällig am 12.01.2024		1.700	1.690	0,56
6,600 % fällig am 12.09.2023		2.138	2.141	0,71
Deutsche Bank AG				
0,898 % fällig am 28.05.2024 (e)		2.500	2.376	0,79
First Abu Dhabi Bank PJSC				
5,019 % fällig am 18.02.2025	AUD	500	332	0,11
6,174 % fällig am 08.08.2023	$	1.000	1.001	0,33
GA Global Funding Trust				
6,380 % fällig am 11.04.2025		700	686	0,23
General Motors Financial Co., Inc.				
1,700 % fällig am 18.08.2023		400	398	0,13
3,950 % fällig am 13.04.2024		1.500	1.477	0,49
5,850 % fällig am 08.03.2024		899	897	0,30
Goldman Sachs Group, Inc.				
5,236 % fällig am 02.05.2024	AUD	1.300	867	0,29
7,063 % fällig am 29.11.2023	$	2.700	2.713	0,90
HSBC Holdings PLC				
6,770 % fällig am 11.03.2025		800	803	0,27
Hyundai Capital Services, Inc.				
0,750 % fällig am 15.09.2023		1.200	1.187	0,39
ING Bank Australia Ltd.				
4,000 % fällig am 26.05.2025	AUD	1.600	1.042	0,34
ING Groep NV				
6,533 % fällig am 02.10.2023	$	1.760	1.762	0,58
Jackson Financial, Inc.				
1,125 % fällig am 22.11.2023		1.000	982	0,32
Jackson National Life Global Funding				
6,242 % fällig am 28.06.2024		400	401	0,13
JPMorgan Chase & Co.				
0,969 % fällig am 23.06.2025	$	1.000	$ 950	0,31
3,797 % fällig am 23.07.2024		709	708	0,23
Lloyds Banking Group PLC				
4,050 % fällig am 16.08.2023		1.000	998	0,33
Mitsubishi HC Capital, Inc.				
3,960 % fällig am 19.09.2023		2.800	2.786	0,92
Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc.				
0,848 % fällig am 15.09.2024		2.000	1.978	0,65
3,837 % fällig am 17.04.2026		500	481	0,16
4,788 % fällig am 18.07.2025		500	493	0,16
6,128 % fällig am 26.07.2023		1.000	1.000	0,33
Mizuho Financial Group, Inc.				
0,849 % fällig am 08.09.2024		2.700	2.673	0,88
6,201 % fällig am 10.07.2024		1.100	1.100	0,36
Morgan Stanley				
5,519 % fällig am 25.01.2024		2.500	2.498	0,83
MUFG Bank Ltd.				
4,883 % fällig am 21.12.2023 (e)	AUD	1.500	999	0,33
National Australia Bank Ltd.				
5,247 % fällig am 26.09.2023		4.000	2.666	0,88
National Bank of Canada				
5,579 % fällig am 06.08.2024	$	3.500	3.493	1,16
Nationwide Building Society				
0,550 % fällig am 22.01.2024		600	582	0,19
Nissan Motor Acceptance Co. LLC				
1,050 % fällig am 08.03.2024		400	384	0,13
3,875 % fällig am 21.09.2023		500	497	0,16
6,153 % fällig am 08.03.2024		700	695	0,23
Nomura Holdings, Inc.				
2,648 % fällig am 16.01.2025		3.800	3.599	1,189
Nordea Bank Abp				
6,403 % fällig am 30.08.2023		1.000	1.001	0,33
Pacific Life Global Funding				
5,710 % fällig am 04.06.2026		1.200	1.182	0,39
Santander UK Group Holdings PLC				
4,796 % fällig am 15.11.2024		1.500	1.489	0,49
Societe Generale S.A.				
4,250 % fällig am 14.09.2023		2.661	2.649	0,88
Standard Chartered PLC				
6,021 % fällig am 23.11.2025		200	198	0,07
Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc.				
6,060 % fällig am 16.10.2023		2.564	2.567	0,85
Toronto-Dominion Bank				
6,000 % fällig am 08.03.2024		200	200	0,07
Toyota Motor Credit Corp.				
5,569 % fällig am 10.01.2025		4.200	4.200	1,39
UBS AG				
5,540 % fällig am 09.08.2024		1.200	1.196	0,40
			100.835	33,35
INDUSTRIEWERTE				
AstraZeneca PLC				
5,995 % fällig am 17.08.2023		400	400	0,13
Ausgrid Finance Pty. Ltd.				
3,750 % fällig am 30.10.2024	AUD	1.000	652	0,22
Baxter International, Inc.				
5,351 % fällig am 01.12.2023	$	3.500	3.493	1,15
Bayer U.S. Finance LLC				
3,875 % fällig am 15.12.2023		1.000	991	0,33
6,562 % fällig am 15.12.2023		2.800	2.797	0,92
Boeing Co.				
1,433 % fällig am 04.02.2024		1.900	1.850	0,61
Broadcom Corp.				
3,625 % fällig am 15.01.2024		499	493	0,16
Charter Communications Operating LLC				
4,500 % fällig am 01.02.2024		1.000	991	0,33
6,949 % fällig am 01.02.2024		1.700	1.707	0,56
Cigna Group				
6,150 % fällig am 15.07.2023		1.400	1.400	0,46
CNH Industrial NV				
4,500 % fällig am 15.08.2023		1.606	1.604	0,53
Daimler Truck Finance North America LLC				
1,125 % fällig am 14.12.2023		1.500	1.469	0,49
5,691 % fällig am 14.12.2023		1.565	1.566	0,52
Energy Transfer LP				
3,900 % fällig am 15.05.2024	$	2.000	$ 1.967	0,65
4,500 % fällig am 15.04.2024		1.500	1.483	0,49
Eni SpA				
4,000 % fällig am 12.09.2023		4.000	3.983	1,32
HCA, Inc.				
5,000 % fällig am 15.03.2024		3.100	3.081	1,02
Hyundai Capital America				
0,800 % fällig am 08.01.2024		2.000	1.948	0,64
Nissan Motor Co. Ltd.				
3,043 % fällig am 15.09.2023		2.200	2.185	0,72
NXP BV				
4,875 % fällig am 01.03.2024		3.800	3.774	1,25
Penske Truck Leasing Co. LP				
3,900 % fällig am 01.02.2024		3.000	2.961	0,98
Siemens Financieringsmaatschappij NV				
5,520 % fällig am 11.03.2024		1.527	1.529	0,51
SK Broadband Co. Ltd.				
3,875 % fällig am 13.08.2023		1.000	998	0,33
Starbucks Corp.				
5,509 % fällig am 14.02.2024		1.707	1.707	0,56
Takeda Pharmaceutical Co. Ltd.				
4,400 % fällig am 26.11.2023		333	331	0,11
Thermo Fisher Scientific, Inc.				
5,562 % fällig am 18.10.2024		3.800	3.800	1,26
Tyson Foods, Inc.				
3,900 % fällig am 28.09.2023		1.000	996	0,33
Westinghouse Air Brake Technologies Corp.				
4,400 % fällig am 15.03.2024		1.000	987	0,33
			51.143	16,91
VERSORGUNGSUNTERNEHMEN				
British Telecommunications PLC				
4,500 % fällig am 04.12.2023		2.700	2.685	0,89
Chugoku Electric Power Co., Inc.				
2,401 % fällig am 27.08.2024		1.000	958	0,32
Enel Finance International NV				
2,650 % fällig am 10.09.2024		1.000	963	0,32
NextEra Energy Capital Holdings, Inc.				
2,940 % fällig am 21.03.2024		300	294	0,10
5,481 % fällig am 03.11.2023		2.000	2.000	0,66
6,112 % fällig am 21.03.2024		500	500	0,17
Pacific Gas & Electric Co.				
1,700 % fällig am 15.11.2023		600	590	0,19
4,250 % fällig am 01.08.2023		800	799	0,26
Transpower New Zealand Ltd.				
5,750 % fällig am 28.08.2023	AUD	6.000	4.001	1,32
Verizon Communications, Inc.				
6,421 % fällig am 15.05.2025	$	1.500	1.513	0,50
Victoria Power Networks Finance Pty. Ltd.				
4,416 % fällig am 23.08.2024	AUD	500	331	0,11
Vodafone Group PLC				
6,250 % fällig am 16.01.2024	$	500	501	0,17
			15.135	5,01
Summe Unternehmensanleihen und Wechsel			167.113	55,27
US-REGIERUNGSBEHÖRDEN				
Federal Home Loan Bank				
5,360 % fällig am 10.05.2024		4.000	3.993	1,32
Ginnie Mae				
5,099 % fällig am 20.09.2066		500	509	0,17
5,924 % fällig am 20.08.2066		488	485	0,16
Uniform Mortgage-Backed Security, TBA				
5,500 % fällig am 01.07.2053		2.150	2.140	0,71
			7.127	2,36
NON-AGENCY-MBS				
DBWF Mortgage Trust				
6,276 % fällig am 19.12.2030		500	493	0,16
Dilosk RMBS DAC				
4,133 % fällig am 20.02.2060	€	303	331	0,11
Sage AR Funding PLC				
5,969 % fällig am 17.11.2030	£	200	248	0,08

BESCHREIBUNG		PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
Towd Point Mortgage Funding PLC				
5,635 % fällig am 20.10.2051	£	174	$ 221	0,07
Towd Point Mortgage Trust				
4,604 % fällig am 25.02.2057	$	79	79	0,03
Trinity Square PLC				
5,316 % fällig am 15.07.2059	£	127	162	0,06
Tudor Rose Mortgages				
5,509 % fällig am 20.06.2048		261	331	0,11
			1.865	0,62
FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE				
Carlyle Euro CLO DAC				
4,213 % fällig am 15.08.2032	€	300	320	0,11
Carlyle Global Market Strategies CLO Ltd.				
6,400 % fällig am 15.07.2031	$	5.996	5.939	1,96
CBAM Ltd.				
6,370 % fällig am 20.10.2029		490	487	0,16
EFS Volunteer LLC				
6,105 % fällig am 25.10.2035		69	69	0,02
Elevation CLO Ltd.				
6,478 % fällig am 15.10.2029		587	587	0,19
Euro-Galaxy CLO DAC				
3,831 % fällig am 24.04.2034	€	250	265	0,09
Greenwood Park CLO Ltd.				
6,270 % fällig am 15.04.2031	$	1.600	1.577	0,52
Harvest CLO DAC				
4,250 % fällig am 26.06.2030	€	222	237	0,08
Madison Park Funding Ltd.				
6,010 % fällig am 15.04.2029	$	190	188	0,06
Magnetite Ltd.				
6,382 % fällig am 18.10.2031		2.400	2.385	0,79
Oak Hill European Credit Partners DAC				
3,940 % fällig am 20.10.2031	€	300	319	0,11
SLM Private Credit Student Loan Trust				
5,842 % fällig am 15.06.2039	$	372	353	0,12
			12.726	4,21

BESCHREIBUNG		PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
STAATSEMISSIONEN				
CPPIB Capital, Inc.				
6,342 % fällig am 04.04.2025	$	3.000	$ 3.048	1,01
Export-Import Bank of Korea				
4,628 % fällig am 30.10.2023	AUD	5.700	3.798	1,25
Israel Government International Bond				
3,750 % fällig am 31.03.2024	ILS	100	27	0,01
Korea Expressway Corp.				
0,928 % fällig am 02.09.2023	AUD	2.500	1.653	0,55
Korea National Oil Corp.				
6,135 % fällig am 16.07.2023	$	800	800	0,26
			9.326	3,08
KURZFRISTIGE INSTRUMENTE				
COMMERCIAL PAPER				
Dominion Resources, Inc.				
5,430 % fällig am 31.07.2023		1.200	1.194	0,40
5,450 % fällig am 26.07.2023		1.500	1.494	0,49
Enbridge, Inc.				
5,470 % fällig am 14.07.2023		2.800	2.794	0,93
Global Payments, Inc.				
5,930 % fällig am 26.07.2023		300	299	0,10
5,950 % fällig am 14.07.2023		2.400	2.394	0,79
Humana, Inc.				
5,500 % fällig am 01.08.2023		2.700	2.687	0,89
Keurig Dr Pepper, Inc.				
5,250 % fällig am 05.07.2023		300	300	0,10
Targa Resources Corp.				
5,950 % fällig am 20.07.2023		1.100	1.097	0,36
Thomson Reuters Corp.				
5,470 % fällig am 18.07.2023		2.800	2.793	0,92
5,500 % fällig am 18.07.2023		800	798	0,26
Trane Technologies Fing Ltd.				
5,550 % fällig am 24.07.2023		3.000	2.989	0,99
VW Credit, Inc.				
5,430 % fällig am 27.07.2023		2.600	2.589	0,86
			21.428	7,09

BESCHREIBUNG		PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
KURZFRISTIGE SCHULDTITEL				
DBS Bank Ltd.				
4,467 % fällig am 22.11.2023 (e)	AUD	7.000	$ 4.660	1,54
JAPAN TREASURY BILLS				
(0,206) % fällig am 18.07.2023 (a)(b)	¥	81.000	560	0,19
(0,188) % fällig am 18.07.2023 (a)(b)		439.000	3.038	1,00
(0,186) % fällig am 07.08.2023 (a)(b)		985.000	6.816	2,25
(0,166) % fällig am 07.08.2023 (a)(b)		375.000	2.595	0,86
			13.009	4,30
Summe kurzfristige Instrumente			39.097	12,93
Summe Übertragbare Wertpapiere			**$ 237.254**	**78,47**
		AKTIEN		
INVESTMENTFONDS				
ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN				
PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (c)		1.919.787	19.117	6,32
BÖRSENGEHANDELTE FONDS				
PIMCO ETFs plc - PIMCO US Dollar Short Maturity UCITS ETF (c)		109.710	10.898	3,61
Summe Investmentfonds			**$ 30.015**	**9,93**

PENSIONSGESCHÄFTE

Kontrahent	Kredit-zins	Abrechnungs-datum	Fälligkeits-datum	Kapital-betrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensions-geschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensions-geschäft[1]	% des Nettovermögens
BPS	5,160 %	30.06.2023	03.07.2023	$ 2.500	U.S. Treasury Notes 2,000 % fällig am 15.08.2025	$ (2.553)	$ 2.500	$ 2.501	0,83
SSB	2,400	30.06.2023	03.07.2023	2.083	U.S. Treasury Notes 1,875 % fällig am 30.06.2026	(2.125)	2.083	2.083	0,69
Summe Pensionsgeschäfte						**$ (4.678)**	**$ 4.583**	**$ 4.584**	**1,52**

[1] Umfasst aufgelaufene Zinsen.

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

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

FUTURES

Beschreibung	Art	Ablauf-monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
3-Month Euribor June Futures	Short	06.2024	162	$ 110	0,04
3-Month SOFR June Futures	Short	09.2024	313	553	0,18
3-Month SONIA Index June Futures	Short	09.2024	120	474	0,16
3-Month SONIA Index March Futures	Short	06.2024	20	108	0,04
Australia Government 3-Year Note September Futures	Short	09.2023	486	188	0,06
Australia Government 10-Year Bond September Futures	Short	09.2023	82	34	0,01
BIST 30 Index August Futures	Long	08.2023	425	56	0,02
CAC 40 Index July Futures	Long	07.2023	18	22	0,01
DAX Index September Futures	Long	09.2023	4	5	0,00
E-mini NASDAQ 100 Index September Futures	Long	09.2023	22	224	0,07
E-Mini Russell 2000 Index September Futures	Long	09.2023	12	5	0,00
E-mini S&P 500 Index September Futures	Long	09.2023	9	31	0,01
Euro STOXX Bank September Futures	Long	09.2023	810	165	0,05
Euro-BTP Italy Government Bond September Futures	Long	09.2023	37	26	0,01
Euro-BTP Italy Government Bond September Futures	Short	09.2023	253	106	0,03
Euro-OAT France Government 10-Year Bond September Futures	Short	09.2023	14	11	0,00
FTSE 100 Index September Futures	Long	09.2023	12	(12)	0,00
FTSE China A50 Index July Futures	Short	07.2023	796	(53)	(0,02)

Beschreibung	Art	Ablauf-monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
FTSE Taiwan Index July Futures	Long	07.2023	213	(89)	(0,03)
FTSE/JSE Index September Futures	Long	09.2023	103	(33)	(0,01)
FTSE/MIB Index September Futures	Long	09.2023	15	72	0,02
IBEX 35 Index July Futures	Long	07.2023	23	70	0,02
MSCI Singapore Index July Futures	Short	07.2023	122	15	0,01
Nikkei 225 Index September Futures	Long	09.2023	38	150	0,05
OMXS30 Index July Futures	Long	07.2023	264	(36)	(0,01)
S&P CNX Nifty Index July Futures	Long	07.2023	383	354	0,12
S&P/Toronto Stock Exchange 60 September Futures	Long	09.2023	1	3	0,00
SPI 200 Index September Futures	Long	09.2023	38	35	0,01
Topix Index September Futures	Long	09.2023	69	356	0,12
U.S. Treasury 2-Year Note September Futures	Long	09.2023	55	(45)	(0,01)
U.S. Treasury 5-Year Note September Futures	Short	09.2023	125	128	0,04
Volatility S&P 500 Index July Futures	Short	07.2023	269	425	0,14
VSTOXX Mini July Futures	Short	07.2023	835	136	0,04
WIG20 Index September Futures	Long	09.2023	689	21	0,01
				$ 3.615	1,19
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate				**$ 3.615**	**1,19**

ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)

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

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES - SCHUTZVERKAUF[1]

Index/Tranchen	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag[2]	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
CDX.EM-39 5-Year Index	1,000 %	20.06.2028	$ 45.800	$ 223	0,07
CDX.HY-40 5-Year Index	5,000	20.06.2028	6.200	83	0,03
iTraxx Crossover 39 5-Year Index	5,000	20.06.2028	€ 5.700	20	0,01
				$ 326	0,11

ZINSSWAPS

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Zahlung[3]	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	3,250 %	20.09.2053	£ 6.100	$ 100	0,03
Erhalt[3]	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	3,500	20.09.2033	36.300	556	0,18
Erhalt[3]	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	4,000	20.09.2025	24.900	311	0,10
Zahlung	1-Day INR-MIBOR Compounded-OIS	6,250	15.03.2028	INR 2.855.400	(222)	(0,07)
Erhalt	1-Day INR-MIBOR Compounded-OIS	6,500	15.03.2028	1.213.800	105	0,03
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,800	15.06.2052	¥ 80.000	(19)	(0,01)
Zahlung[3]	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,850	20.09.2033	6.760.000	(118)	(0,04)
Zahlung[3]	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	1,200	20.09.2053	1.660.000	(44)	(0,01)
Erhalt	1-Day SGD-SIBCSORA Compounded-OIS	2,750	15.03.2028	SGD 35.700	264	0,09
Erhalt	1-Day SGD-SIBCSORA Compounded-OIS	3,000	15.03.2028	16.800	97	0,03
Erhalt[3]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,000	20.09.2028	$ 4.900	55	0,02
Erhalt[3]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,000	20.09.2033	4.000	11	0,00
Erhalt[3]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	3,000	20.09.2053	2.400	(23)	(0,01)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	5,338	02.01.2025	BRL 14.100	(182)	(0,06)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	5,580	02.01.2025	10.300	(205)	(0,07)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	5,770	02.01.2025	3.300	(71)	(0,02)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	5,840	02.01.2025	11.400	(244)	(0,08)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	5,877	02.01.2025	3.000	(61)	(0,02)
Erhalt	1-Year BRL-CDI	6,620	02.01.2025	5.500	108	0,04
Erhalt	1-Year BRL-CDI	6,630	02.01.2025	4.900	96	0,03
Erhalt	1-Year BRL-CDI	6,840	02.01.2025	16.800	384	0,13
Erhalt	1-Year BRL-CDI	7,010	02.01.2025	7.900	173	0,06
Erhalt	1-Year BRL-CDI	7,328	02.01.2025	20.000	398	0,13
Zahlung	1-Year BRL-CDI	7,715	02.01.2025	7.800	(150)	(0,05)
Erhalt	1-Year BRL-CDI	7,733	02.01.2025	8.200	148	0,05
Erhalt	1-Year BRL-CDI	8,180	02.01.2025	14.600	246	0,08
Zahlung	1-Year BRL-CDI	8,550	02.01.2025	700	(11)	0,00
Erhalt	1-Year BRL-CDI	8,730	02.01.2025	21.700	305	0,10
Erhalt	1-Year BRL-CDI	8,985	02.01.2025	10.900	138	0,05
Erhalt	1-Year BRL-CDI	9,525	02.01.2025	13.300	132	0,04
Erhalt	1-Year BRL-CDI	9,630	02.01.2025	4.500	40	0,01
Erhalt	1-Year BRL-CDI	10,295	04.01.2027	6.000	(34)	(0,01)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	10,445	04.01.2027	20.100	(56)	(0,02)
Erhalt	1-Year BRL-CDI	10,480	02.01.2029	28.400	(34)	(0,01)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	10,813	02.01.2025	10.500	(40)	(0,01)
Erhalt	1-Year BRL-CDI	11,043	04.01.2027	10.400	(12)	0,00
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,070	04.01.2027	8.900	10	0,00

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits-datum		Nenn-betrag		Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,080 %	02.01.2029	BRL	15.500	$	47	0,02
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,106	02.01.2029		26.900		130	0,04
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,180	04.01.2027		17.900		32	0,01
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,240	04.01.2027		24.300		86	0,03
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,310	02.01.2029		22.800		137	0,05
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,350	04.01.2027		63.000		237	0,08
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,360	02.01.2029		24.000		151	0,05
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,426	04.01.2027		7.500		30	0,01
Erhalt	1-Year BRL-CDI	11,451	04.01.2027		37.800		(177)	(0,06)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,505	04.01.2027		25.100		283	0,09
Erhalt	1-Year BRL-CDI	11,595	04.01.2027		28.200		(155)	(0,05)
Erhalt	1-Year BRL-CDI	11,620	04.01.2027		36.700		(256)	(0,08)
Erhalt	1-Year BRL-CDI	11,660	02.01.2029		500		(4)	0,00
Erhalt	1-Year BRL-CDI	11,665	04.01.2027		9.100		(44)	(0,01)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,837	02.01.2029		63.300		570	0,19
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,890	02.01.2025		66.400		152	0,05
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,918	04.01.2027		28.000		189	0,06
Zahlung	1-Year BRL-CDI	11,940	02.01.2029		17.600		169	0,06
Erhalt	1-Year BRL-CDI	11,945	04.01.2027		21.800		(146)	(0,05)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	12,058	02.01.2029		89.700		924	0,31
Zahlung	1-Year BRL-CDI	12,080	04.01.2027		12.200		94	0,03
Erhalt	1-Year BRL-CDI	12,140	04.01.2027		6.000		(47)	(0,02)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	12,190	02.01.2029		19.900		220	0,07
Erhalt	1-Year BRL-CDI	12,195	04.01.2027		25.200		(230)	(0,08)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	12,260	04.01.2027		27.200		257	0,09
Erhalt	1-Year BRL-CDI	12,455	04.01.2027		7.900		(76)	(0,03)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	12,455	02.01.2029		16.600		202	0,07
Zahlung	1-Year BRL-CDI	12,560	02.01.2029		36.400		480	0,16
Zahlung	1-Year BRL-CDI	12,640	02.01.2029		34.000		463	0,15
Erhalt	1-Year BRL-CDI	12,718	04.01.2027		35.400		(395)	(0,13)
Erhalt	1-Year BRL-CDI	12,740	04.01.2027		45.700		(534)	(0,18)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	12,770	04.01.2027		11.000		126	0,04
Erhalt	1-Year BRL-CDI	13,030	04.01.2027		35.600		(475)	(0,16)
Erhalt	1-Year BRL-CDI	13,080	04.01.2027		47.200		(634)	(0,21)
Erhalt	1-Year BRL-CDI	13,165	04.01.2027		27.200		(325)	(0,11)
Erhalt	1-Year BRL-CDI	13,190	04.01.2027		34.700		(485)	(0,16)
Zahlung	1-Year BRL-CDI	13,280	04.01.2027		9.600		137	0,05
Erhalt[3]	3-Month CAD-CAONREPO Compounded-OIS	3,000	20.09.2028	CAD	18.500		92	0,03
Erhalt[3]	3-Month CAD-CAONREPO Compounded-OIS	3,000	20.09.2033		30.100		(73)	(0,02)
Zahlung[3]	3-Month CAD-CAONREPO Compounded-OIS	3,250	20.09.2053		8.500		105	0,03
Erhalt[3]	3-Month CAD-CAONREPO Compounded-OIS	3,750	20.09.2025		67.800		320	0,11
Zahlung	3-Month CNY-CNREPOFIX	2,250	21.12.2027	CNY	61.900		73	0,02
Zahlung	3-Month CNY-CNREPOFIX	2,645	16.12.2025		8.600		8	0,00
Erhalt	3-Month CNY-CNREPOFIX	2,750	15.03.2028		123.500		(186)	(0,06)
Zahlung	3-Month CNY-CNREPOFIX	3,000	15.03.2028		373.000		553	0,18
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	3,034	13.01.2026	COP	2.305.800		(79)	(0,03)
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	3,220	11.12.2025		1.542.400		20	0,01
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	3,295	09.10.2025		1.638.900		(29)	(0,01)
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	3,400	28.08.2025		1.571.400		24	0,01
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	3,850	24.04.2025		2.558.800		(51)	(0,02)
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	3,940	05.03.2026		4.713.300		126	0,04
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	4,110	23.03.2026		6.908.300		173	0,06
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	4,240	16.04.2026		4.566.900		129	0,04
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	4,350	27.03.2025		625.600		12	0,00
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	4,360	30.03.2025		836.600		16	0,01
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	4,490	30.04.2026		3.271.600		(86)	(0,03)
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	4,660	11.06.2026		1.410.500		32	0,01
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	4,880	07.05.2026		3.283.600		(76)	(0,03)
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	5,150	13.03.2025		121.800		3	0,00
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	5,980	14.10.2026		4.816.400		(87)	(0,03)
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	6,190	05.11.2026		9.002.000		137	0,05
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	6,360	19.11.2026		5.335.800		(71)	(0,02)
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	6,410	08.11.2026		5.252.200		91	0,03
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	6,950	04.02.2027		6.498.500		61	0,02
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	7,730	28.06.2028		15.146.400		12	0,00
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	7,900	08.04.2027		4.251.300		(10)	0,00
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	8,106	15.06.2028		22.329.600		102	0,03
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	8,494	27.05.2027		5.817.600		(24)	(0,01)
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	8,588	11.04.2028		27.727.300		192	0,06
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	8,700	10.04.2028		5.318.200		42	0,01
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	8,750	27.03.2028		21.497.700		220	0,07
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	8,830	28.04.2028		19.856.000		(231)	(0,08)
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	8,850	06.05.2027		6.000.000		(38)	(0,01)
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	8,970	05.08.2027		8.528.200		71	0,02
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	8,970	08.02.2028		9.288.600		98	0,03
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	8,990	08.02.2028		22.636.600		243	0,08
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	8,992	08.02.2028		23.240.200		250	0,08
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	9,020	24.03.2028		33.052.700		418	0,14
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	9,040	08.02.2028		4.678.200		52	0,02
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	9,140	07.02.2028		41.500.400		503	0,17
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	9,160	20.05.2027		8.106.600		(75)	(0,02)

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits-datum		Nenn-betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	10,050 %	09.09.2027	COP	8.150.200	$ (154)	(0,05)
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	10,210	18.11.2027		3.214.900	67	0,02
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	10,240	24.02.2028		72.000.000	(1.647)	(0,54)
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	10,275	18.11.2027		6.380.400	137	0,05
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	10,390	30.09.2027		10.319.800	(228)	(0,08)
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	10,420	21.11.2027		6.380.400	146	0,05
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	10,430	21.11.2027		6.563.400	150	0,05
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	10,443	21.11.2027		19.784.200	456	0,15
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	10,478	29.09.2027		10.549.600	(241)	(0,08)
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	10,800	31.10.2027		32.387.900	(1.063)	(0,35)
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	10,810	14.10.2027		5.776.200	(145)	(0,05)
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	10,920	18.10.2027		2.950.700	(77)	(0,03)
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	10,940	18.10.2027		5.920.600	(156)	(0,05)
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	11,424	21.10.2027		13.833.600	425	0,14
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	11,450	21.10.2027		4.011.800	124	0,04
Erhalt	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	11,800	24.10.2027		33.238.700	(1.066)	(0,35)
Zahlung	3-Month COP-IBR Compounded-OIS	11,850	24.10.2027		1.323.300	46	0,02
Zahlung	3-Month HKD-HIBOR	0,500	17.03.2026	HKD	26.700	(61)	(0,02)
Zahlung	3-Month HKD-HIBOR	0,508	17.03.2026		4.700	(11)	0,00
Erhalt	3-Month HKD-HIBOR	0,550	16.12.2025		4.700	10	0,00
Zahlung	3-Month HKD-HIBOR	0,560	17.03.2026		3.200	(7)	0,00
Zahlung	3-Month HKD-HIBOR	0,565	16.12.2025		7.800	(17)	(0,01)
Erhalt	3-Month HKD-HIBOR	0,568	17.03.2026		6.300	14	0,00
Zahlung	3-Month HKD-HIBOR	0,583	16.12.2025		7.900	(17)	(0,01)
Erhalt	3-Month HKD-HIBOR	0,607	17.03.2026		9.400	22	0,01
Erhalt	3-Month HKD-HIBOR	0,608	17.03.2026		7.900	18	0,01
Zahlung	3-Month HKD-HIBOR	0,618	16.09.2025		7.800	(16)	(0,01)
Erhalt	3-Month HKD-HIBOR	0,670	17.03.2026		12.600	29	0,01
Zahlung	3-Month HKD-HIBOR	0,680	16.12.2025		3.200	(7)	0,00
Erhalt	3-Month HKD-HIBOR	0,698	16.12.2025		3.100	7	0,00
Erhalt	3-Month HKD-HIBOR	0,700	16.09.2025		11.100	22	0,01
Erhalt	3-Month HKD-HIBOR	0,750	15.09.2026		39.600	88	0,03
Zahlung	3-Month HKD-HIBOR	0,790	16.09.2025		4.700	(10)	0,00
Erhalt	3-Month HKD-HIBOR	0,867	17.03.2026		31.700	74	0,02
Zahlung	3-Month HKD-HIBOR	0,883	15.09.2026		7.800	(20)	(0,01)
Erhalt	3-Month HKD-HIBOR	1,000	17.03.2026		11.100	26	0,01
Zahlung	3-Month HKD-HIBOR	1,000	16.06.2026		43.400	(109)	(0,04)
Erhalt	3-Month HKD-HIBOR	1,085	16.09.2025		11.200	23	0,01
Erhalt	3-Month HKD-HIBOR	1,100	16.06.2026		12.700	32	0,01
Erhalt	3-Month HKD-HIBOR	1,120	17.06.2025		3.200	6	0,00
Erhalt	3-Month HKD-HIBOR	1,250	15.12.2026		48.800	149	0,05
Zahlung	3-Month HKD-HIBOR	1,340	18.03.2025		8.000	(12)	0,00
Zahlung	3-Month HKD-HIBOR	1,500	16.03.2027		48.910	(157)	(0,05)
Zahlung	3-Month HKD-HIBOR	1,600	17.06.2025		5.900	(11)	0,00
Zahlung	3-Month HKD-HIBOR	1,715	18.03.2025		10.800	(17)	(0,01)
Erhalt	3-Month HKD-HIBOR	1,750	16.03.2027		9.800	29	0,01
Erhalt	3-Month HKD-HIBOR	2,000	16.03.2027		11.500	35	0,01
Zahlung	3-Month HKD-HIBOR	2,750	16.03.2027		18.400	(59)	(0,02)
Zahlung	3-Month HKD-HIBOR	3,000	15.06.2027		5.000	(16)	(0,01)
Erhalt	3-Month HKD-HIBOR	3,000	21.09.2027		10.400	29	0,01
Erhalt	3-Month HKD-HIBOR	3,250	21.09.2027		46.600	166	0,05
Zahlung	3-Month HKD-HIBOR	3,250	15.03.2028		287.300	(1.198)	(0,40)
Erhalt	3-Month HKD-HIBOR	3,500	21.09.2027		27.940	96	0,03
Erhalt	3-Month HKD-HIBOR	3,750	21.09.2027		40.600	149	0,05
Erhalt	3-Month HKD-HIBOR	3,750	15.03.2028		229.200	126	0,04
Zahlung	3-Month HKD-HIBOR	4,000	21.12.2027		88.700	31	0,01
Erhalt	3-Month HKD-HIBOR	4,500	21.12.2027		150.900	(64)	(0,02)
Zahlung	3-Month ILS-TELBOR	0,520	26.07.2026	ILS	24.300	(658)	(0,22)
Erhalt	3-Month ILS-TELBOR	0,601	05.07.2026		2.800	77	0,03
Zahlung	3-Month ILS-TELBOR	0,628	25.06.2026		5.600	(140)	(0,05)
Erhalt	3-Month ILS-TELBOR	0,692	13.09.2026		48.400	1.203	0,40
Zahlung	3-Month ILS-TELBOR	0,728	04.06.2026		4.100	(106)	(0,04)
Erhalt	3-Month ILS-TELBOR	0,730	21.05.2026		3.500	88	0,03
Zahlung	3-Month ILS-TELBOR	0,750	10.12.2026		34.100	(899)	(0,30)
Zahlung	3-Month ILS-TELBOR	0,900	07.10.2026		9.000	(227)	(0,08)
Zahlung	3-Month ILS-TELBOR	0,905	25.11.2026		8.100	(217)	(0,07)
Erhalt	3-Month ILS-TELBOR	0,965	14.01.2027		10.600	283	0,09
Zahlung	3-Month ILS-TELBOR	1,040	28.10.2026		10.400	(257)	(0,08)
Erhalt	3-Month ILS-TELBOR	1,049	12.11.2026		12.000	282	0,09
Erhalt	3-Month ILS-TELBOR	1,105	21.01.2027		16.900	425	0,14
Erhalt	3-Month ILS-TELBOR	1,178	04.02.2027		13.800	335	0,11
Erhalt	3-Month ILS-TELBOR	2,183	06.05.2027		7.500	116	0,04
Erhalt	3-Month ILS-TELBOR	2,390	27.05.2027		11.400	159	0,05
Erhalt	3-Month ILS-TELBOR	2,666	18.07.2027		7.500	17	0,01
Erhalt	3-Month ILS-TELBOR	2,670	15.07.2027		34.800	(91)	(0,03)
Zahlung	3-Month ILS-TELBOR	2,825	10.06.2027		10.900	(105)	(0,03)
Erhalt	3-Month ILS-TELBOR	3,210	17.06.2027		1.900	21	0,01
Zahlung	3-Month ILS-TELBOR	3,260	18.11.2027		38.400	(68)	(0,02)
Zahlung	3-Month ILS-TELBOR	3,290	16.11.2027		25.363	(23)	(0,01)
Zahlung	3-Month ILS-TELBOR	3,530	03.04.2028		69.500	(196)	(0,06)
Zahlung	3-Month ILS-TELBOR	3,590	31.03.2028		24.500	23	0,01

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits-datum		Nenn-betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Zahlung	3-Month ILS-TELBOR	3,590 %	18.05.2028	ILS	23.700	$ 45	0,01
Erhalt	3-Month ILS-TELBOR	3,619	05.01.2028		27.400	(13)	0,00
Erhalt	3-Month ILS-TELBOR	3,650	02.01.2028		18.900	(17)	(0,01)
Erhalt	3-Month ILS-TELBOR	3,670	30.12.2027		19.000	(80)	(0,03)
Erhalt	3-Month ILS-TELBOR	3,720	21.10.2027		72.900	(271)	(0,09)
Erhalt	3-Month ILS-TELBOR	3,980	23.02.2028		8.600	(45)	(0,01)
Erhalt	3-Month ILS-TELBOR	4,030	24.02.2028		54.700	(455)	(0,15)
Zahlung	3-Month ILS-TELBOR	4,130	03.03.2028		30.000	91	0,03
Erhalt	3-Month KRW-KORIBOR	3,000	21.06.2028	KRW	25.301.100	127	0,04
Zahlung	3-Month KRW-KORIBOR	3,250	15.03.2028		37.768.000	(630)	(0,21)
Zahlung	3-Month KRW-KORIBOR	3,500	15.03.2028		10.054.900	(140)	(0,05)
Erhalt	3-Month KRW-KORIBOR	3,500	15.03.2028		32.096.900	343	0,11
Erhalt	3-Month THB-THORON Compounded-OIS	2,000	15.03.2028	THB	397.700	142	0,05
Zahlung	3-Month THB-THORON Compounded-OIS	2,250	15.03.2028		382.200	(103)	(0,03)
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	4,900	12.11.2025	ZAR	3.400	(15)	(0,01)
Erhalt	3-Month ZAR-JIBAR	4,938	18.09.2025		7.000	32	0,01
Erhalt	3-Month ZAR-JIBAR	5,120	02.09.2025		500	2	0,00
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	5,330	13.05.2025		8.300	(42)	(0,01)
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	5,375	27.05.2025		7.800	(40)	(0,01)
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	5,601	09.06.2026		31.050	(124)	(0,04)
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	5,680	08.06.2026		41.150	(167)	(0,06)
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	5,739	28.07.2026		72.100	(292)	(0,10)
Erhalt	3-Month ZAR-JIBAR	5,780	03.03.2026		36.600	125	0,04
Erhalt	3-Month ZAR-JIBAR	5,860	23.06.2026		75.600	273	0,09
Erhalt	3-Month ZAR-JIBAR	5,950	17.03.2026		1.200	4	0,00
Erhalt	3-Month ZAR-JIBAR	5,980	22.09.2026		43.900	164	0,05
Erhalt	3-Month ZAR-JIBAR	6,023	01.07.2026		28.100	98	0,03
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	6,200	22.04.2025		7.800	(51)	(0,02)
Erhalt	3-Month ZAR-JIBAR	6,231	29.09.2026		55.400	185	0,06
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	6,300	23.12.2026		30.900	(108)	(0,04)
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	6,320	23.04.2025		5.600	(38)	(0,01)
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	6,400	30.12.2026		33.600	(112)	(0,04)
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	6,540	04.01.2027		37.100	(120)	(0,04)
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	6,540	23.02.2027		64.600	(213)	(0,07)
Erhalt	3-Month ZAR-JIBAR	6,670	12.01.2027		73.700	225	0,07
Erhalt	3-Month ZAR-JIBAR	6,690	04.11.2026		2.000	6	0,00
Erhalt	3-Month ZAR-JIBAR	6,835	28.08.2024		100	1	0,00
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	6,855	03.11.2026		22.830	(58)	(0,02)
Erhalt	3-Month ZAR-JIBAR	7,049	09.03.2027		70.000	173	0,06
Erhalt	3-Month ZAR-JIBAR	7,489	18.05.2027		112.100	128	0,04
Erhalt	3-Month ZAR-JIBAR	7,600	19.06.2024		7.100	56	0,02
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	7,705	10.01.2028		504.000	(962)	(0,32)
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	7,710	06.05.2027		22.200	(1)	0,00
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	7,730	09.01.2028		119.300	(212)	(0,07)
Erhalt	3-Month ZAR-JIBAR	7,740	17.08.2027		63.300	(24)	(0,01)
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	7,750	20.03.2024		9.180	(70)	(0,02)
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	7,800	19.12.2023		3.100	(22)	(0,01)
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	7,900	06.01.2028		119.300	(169)	(0,06)
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	8,055	14.11.2027		8.400	(2)	0,00
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	8,064	27.07.2027		21.200	(46)	(0,02)
Erhalt	3-Month ZAR-JIBAR	8,120	13.03.2028		99.500	37	0,01
Erhalt	3-Month ZAR-JIBAR	8,205	17.02.2028		241.300	202	0,07
Erhalt	3-Month ZAR-JIBAR	8,430	23.02.2028		152.700	59	0,02
Erhalt	3-Month ZAR-JIBAR	8,465	23.02.2028		240.400	75	0,02
Erhalt	3-Month ZAR-JIBAR	8,500	17.10.2027		12.000	(1)	0,00
Erhalt	3-Month ZAR-JIBAR	8,510	25.04.2028		262.000	69	0,02
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	8,560	25.04.2028		72.800	3	0,00
Erhalt	3-Month ZAR-JIBAR	8,950	11.05.2028		67.000	(88)	(0,03)
Zahlung	3-Month ZAR-JIBAR	9,185	12.06.2028		87.400	(10)	0,00
Erhalt	3-Month ZAR-JIBAR	9,350	18.05.2028		56.800	(55)	(0,02)
Erhalt[3]	6-Month AUD-BBR-BBSW	4,000	20.09.2025	AUD	102.900	167	0,06
Zahlung[3]	6-Month AUD-BBR-BBSW	4,500	20.09.2033		23.400	(66)	(0,02)
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	3,570	09.07.2026	CLP	1.279.600	(157)	(0,05)
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	3,728	20.08.2026		2.239.800	236	0,08
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	5,133	23.06.2028		3.579.500	(23)	(0,01)
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	5,158	15.06.2028		7.959.600	(65)	(0,02)
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	5,220	19.11.2026		2.363.300	(60)	(0,02)
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	5,230	14.06.2028		1.732.400	(4)	0,00
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	5,237	14.06.2028		2.356.600	(10)	0,00
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	5,261	17.11.2027		3.774.600	(56)	(0,02)
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	5,280	17.11.2027		3.854.600	(53)	(0,02)
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	5,290	13.06.2028		1.707.900	1	0,00
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	5,293	21.03.2028		4.537.600	(97)	(0,03)
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	5,300	17.11.2027		940.100	(10)	0,00
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	5,300	22.03.2028		5.848.400	(122)	(0,04)
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	5,358	18.11.2027		2.390.300	(19)	(0,01)
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	5,420	28.10.2026		1.284.200	34	0,01
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	5,420	18.11.2027		7.201.400	(47)	(0,02)
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	5,458	20.03.2028		7.549.300	(95)	(0,03)
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	5,530	18.11.2027		2.406.700	2	0,00
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	5,620	22.10.2026		1.673.000	26	0,01

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits-datum		Nenn-betrag		Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	5,650 %	03.02.2028	CLP	5.748.800	$	70	0,02
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	5,650	01.06.2028		2.946.200		(45)	(0,01)
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	5,699	01.06.2028		4.644.000		(84)	(0,03)
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	5,780	31.05.2028		1.398.200		(31)	(0,01)
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	5,798	31.05.2028		5.567.800		(129)	(0,04)
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	5,830	25.04.2028		5.063.700		58	0,02
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	5,975	18.01.2027		1.912.300		28	0,01
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	6,000	16.02.2028		5.590.200		(58)	(0,02)
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	6,207	31.05.2027		1.836.600		49	0,02
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	6,210	27.03.2026		10.738.200		(112)	(0,04)
Zahlung	6-Month CLP-CHILIBOR	6,230	27.05.2027		1.675.600		44	0,01
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	6,370	03.03.2028		4.119.100		(142)	(0,05)
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	6,380	03.03.2028		4.366.200		(153)	(0,05)
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	6,385	07.03.2028		6.138.400		(222)	(0,07)
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	6,490	06.03.2028		8.848.600		(369)	(0,12)
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	6,885	13.05.2027		1.642.400		(85)	(0,03)
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	7,160	21.10.2027		5.870.000		(409)	(0,14)
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	7,161	17.06.2027		2.386.300		(174)	(0,06)
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	7,174	17.06.2027		1.432.400		(109)	(0,04)
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	7,420	09.09.2027		2.595.500		(206)	(0,07)
Erhalt	6-Month CLP-CHILIBOR	7,900	30.09.2027		2.317.200		(250)	(0,08)
Zahlung	6-Month CZK-PRIBOR	0,421	15.05.2025	CZK	900		(3)	0,00
Zahlung	6-Month CZK-PRIBOR	0,590	26.03.2025		10.900		(46)	(0,01)
Zahlung	6-Month CZK-PRIBOR	0,637	24.07.2025		7.700		(38)	(0,01)
Zahlung	6-Month CZK-PRIBOR	0,665	22.09.2025		5.100		(24)	(0,01)
Zahlung	6-Month CZK-PRIBOR	0,690	04.05.2025		4.100		(17)	(0,01)
Zahlung	6-Month CZK-PRIBOR	0,710	30.03.2025		100		0	0,00
Zahlung	6-Month CZK-PRIBOR	0,776	20.08.2025		7.900		(39)	(0,01)
Erhalt	6-Month CZK-PRIBOR	1,100	31.12.2025		57.000		256	0,08
Zahlung	6-Month CZK-PRIBOR	1,124	13.03.2025		12.000		(58)	(0,02)
Erhalt	6-Month CZK-PRIBOR	1,570	09.03.2026		59.800		298	0,10
Erhalt	6-Month CZK-PRIBOR	1,580	19.03.2026		51.600		237	0,08
Zahlung	6-Month CZK-PRIBOR	1,715	23.07.2026		100.200		(494)	(0,16)
Zahlung	6-Month CZK-PRIBOR	1,775	04.06.2026		57.900		(256)	(0,08)
Erhalt	6-Month CZK-PRIBOR	1,934	02.07.2026		95.200		450	0,15
Erhalt	6-Month CZK-PRIBOR	1,972	07.07.2026		55.500		266	0,09
Erhalt	6-Month CZK-PRIBOR	2,015	10.08.2026		132.200		536	0,18
Erhalt	6-Month CZK-PRIBOR	3,340	06.01.2032		171.700		(114)	(0,04)
Zahlung	6-Month CZK-PRIBOR	3,770	11.02.2027		72.000		(159)	(0,05)
Zahlung	6-Month CZK-PRIBOR	4,195	21.03.2033		125.300		(28)	(0,01)
Zahlung	6-Month CZK-PRIBOR	4,220	21.03.2033		67.600		(7)	0,00
Erhalt	6-Month CZK-PRIBOR	4,300	18.03.2027		80.900		94	0,03
Zahlung	6-Month CZK-PRIBOR	4,420	22.03.2028		172.600		(103)	(0,03)
Zahlung	6-Month CZK-PRIBOR	4,420	05.05.2032		9.700		(10)	0,00
Zahlung	6-Month CZK-PRIBOR	4,420	01.06.2033		89.100		(25)	(0,01)
Zahlung	6-Month CZK-PRIBOR	4,440	12.12.2027		253.100		166	0,06
Erhalt	6-Month CZK-PRIBOR	4,455	01.06.2033		90.400		(96)	(0,03)
Zahlung	6-Month CZK-PRIBOR	4,510	22.03.2028		151.800		(62)	(0,02)
Zahlung	6-Month CZK-PRIBOR	4,560	09.12.2027		156.700		140	0,05
Zahlung	6-Month CZK-PRIBOR	4,630	21.03.2028		151.800		(26)	(0,01)
Zahlung	6-Month CZK-PRIBOR	4,640	07.12.2027		156.700		163	0,05
Zahlung	6-Month CZK-PRIBOR	4,680	08.12.2027		156.700		178	0,06
Zahlung	6-Month CZK-PRIBOR	4,695	04.05.2028		116.300		18	0,01
Zahlung	6-Month CZK-PRIBOR	4,735	04.05.2028		95.500		23	0,01
Erhalt	6-Month CZK-PRIBOR	5,070	20.04.2028		101.000		(86)	(0,03)
Erhalt	6-Month CZK-PRIBOR	5,090	20.04.2028		121.900		(109)	(0,04)
Zahlung	6-Month CZK-PRIBOR	5,103	16.11.2027		240.300		456	0,15
Zahlung	6-Month CZK-PRIBOR	5,140	11.07.2027		58.000		85	0,03
Zahlung	6-Month CZK-PRIBOR	5,175	11.07.2027		82.400		83	0,03
Erhalt	6-Month CZK-PRIBOR	5,175	23.02.2028		48.100		(39)	(0,01)
Erhalt	6-Month CZK-PRIBOR	5,185	24.05.2027		64.000		(38)	(0,01)
Erhalt	6-Month CZK-PRIBOR	5,215	24.02.2028		249.500		(242)	(0,08)
Erhalt	6-Month CZK-PRIBOR	5,264	02.03.2028		224.100		(288)	(0,10)
Erhalt	6-Month CZK-PRIBOR	5,285	20.05.2027		83.300		(62)	(0,02)
Erhalt	6-Month CZK-PRIBOR	5,538	02.09.2027		52.400		(131)	(0,04)
Erhalt	6-Month CZK-PRIBOR	5,640	10.06.2027		3.400		(5)	0,00
Erhalt	6-Month CZK-PRIBOR	5,740	03.10.2027		121.600		(372)	(0,12)
Erhalt	6-Month CZK-PRIBOR	5,788	20.10.2027		538.000		(1.910)	(0,63)
Zahlung[3]	6-Month EUR-EURIBOR	2,500	20.09.2053	€	300		(1)	0,00
Zahlung[3]	6-Month EUR-EURIBOR	3,000	20.09.2033		19.300		(32)	(0,01)
Erhalt[3]	6-Month EUR-EURIBOR	3,500	20.09.2025		104.700		651	0,22
Erhalt	6-Month HUF-BBR	1,085	14.08.2025	HUF	186.300		112	0,04
Zahlung	6-Month HUF-BBR	1,115	08.01.2026		1.131.600		(790)	(0,26)
Erhalt	6-Month HUF-BBR	1,220	15.01.2026		559.700		392	0,13
Erhalt	6-Month HUF-BBR	1,230	15.01.2026		872.700		612	0,20
Zahlung	6-Month HUF-BBR	1,920	16.04.2026		426.000		(255)	(0,08)
Erhalt	6-Month HUF-BBR	1,958	19.03.2026		1.746.000		1.055	0,35
Erhalt	6-Month HUF-BBR	1,980	09.03.2026		646.300		400	0,13
Erhalt	6-Month HUF-BBR	2,499	05.07.2026		78.800		49	0,02
Erhalt	6-Month HUF-BBR	2,558	06.08.2026		1.156.900		676	0,22
Zahlung	6-Month HUF-BBR	5,060	18.02.2027		885.100		(363)	(0,12)

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits-datum		Nenn-betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Erhalt	6-Month HUF-BBR	5,500 %	04.03.2027	HUF	627.800	$ 226	0,07
Erhalt	6-Month HUF-BBR	6,100	11.03.2027		498.000	148	0,05
Zahlung	6-Month HUF-BBR	7,480	03.06.2027		700.700	19	0,01
Erhalt	6-Month HUF-BBR	7,640	13.05.2027		721.400	72	0,02
Zahlung	6-Month HUF-BBR	8,320	20.01.2028		729.300	(41)	(0,01)
Zahlung	6-Month HUF-BBR	8,500	25.01.2028		5.485.200	(38)	(0,01)
Zahlung	6-Month HUF-BBR	8,550	24.01.2028		1.174.900	(30)	(0,01)
Zahlung	6-Month HUF-BBR	8,650	19.01.2028		731.300	(13)	0,00
Zahlung	6-Month HUF-BBR	8,740	28.04.2028		4.915.800	130	0,04
Zahlung	6-Month HUF-BBR	8,800	27.04.2028		1.126.200	78	0,03
Erhalt	6-Month HUF-BBR	9,490	11.04.2028		2.501.700	(344)	(0,11)
Erhalt	6-Month HUF-BBR	9,500	11.04.2028		1.025.500	(142)	(0,05)
Erhalt	6-Month HUF-BBR	9,510	11.04.2028		1.038.900	(184)	(0,06)
Zahlung	6-Month HUF-BBR	9,625	15.08.2027		695.900	234	0,08
Zahlung	6-Month HUF-BBR	9,750	22.11.2027		283.976	83	0,03
Zahlung	6-Month HUF-BBR	9,800	16.11.2027		2.235.924	655	0,22
Erhalt	6-Month HUF-BBR	9,900	16.12.2027		162.500	(54)	(0,02)
Zahlung	6-Month HUF-BBR	10,000	18.11.2027		319.400	102	0,03
Erhalt	6-Month HUF-BBR	10,050	15.12.2027		164.000	(57)	(0,02)
Zahlung	6-Month HUF-BBR	10,070	18.07.2027		428.900	109	0,04
Zahlung	6-Month HUF-BBR	10,100	15.07.2027		488.900	125	0,04
Erhalt	6-Month HUF-BBR	10,340	15.12.2027		334.200	(128)	(0,04)
Erhalt	6-Month HUF-BBR	11,140	23.12.2027		2.021.500	(932)	(0,31)
Zahlung	6-Month HUF-BBR	11,350	11.11.2027		289.300	111	0,04
Erhalt	6-Month HUF-BBR	11,524	12.09.2027		2.052.600	(899)	(0,30)
Erhalt	6-Month HUF-BBR	11,650	09.09.2027		359.200	(170)	(0,06)
Erhalt	6-Month HUF-BBR	12,500	19.10.2027		4.079.400	(2.513)	(0,83)
Zahlung	6-Month PLN-WIBOR	0,481	11.08.2025	PLN	3.400	(99)	(0,03)
Zahlung	6-Month PLN-WIBOR	0,560	17.04.2025		1.900	(48)	(0,02)
Zahlung	6-Month PLN-WIBOR	0,580	11.01.2026		8.500	(291)	(0,10)
Zahlung	6-Month PLN-WIBOR	0,585	22.09.2025		6.000	(172)	(0,06)
Zahlung	6-Month PLN-WIBOR	0,635	08.05.2025		1.100	(28)	(0,01)
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR	0,730	05.02.2026		6.500	217	0,07
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR	0,890	12.02.2026		20.900	674	0,22
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR	1,188	19.03.2026		17.800	493	0,16
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR	1,229	09.03.2026		7.000	206	0,07
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR	1,405	10.08.2026		27.100	767	0,25
Zahlung	6-Month PLN-WIBOR	1,450	05.07.2026		5.300	(165)	(0,05)
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR	1,465	07.06.2026		2.400	63	0,02
Zahlung	6-Month PLN-WIBOR	2,185	08.10.2026		8.300	(181)	(0,06)
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR	2,983	08.11.2026		20.100	276	0,09
Zahlung	6-Month PLN-WIBOR	3,525	24.12.2026		3.300	(29)	(0,01)
Zahlung	6-Month PLN-WIBOR	3,600	27.12.2026		3.300	(26)	(0,01)
Zahlung	6-Month PLN-WIBOR	3,739	03.01.2027		1.000	(15)	(0,01)
Zahlung	6-Month PLN-WIBOR	3,934	04.03.2027		19.200	(95)	(0,03)
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR	4,219	04.02.2027		10.200	112	0,04
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR	4,830	18.03.2027		2.000	8	0,00
Zahlung	6-Month PLN-WIBOR	4,930	29.06.2028		24.400	(16)	(0,01)
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR	5,179	01.04.2027		7.900	6	0,00
Zahlung	6-Month PLN-WIBOR	5,300	12.01.2028		23.800	11	0,00
Zahlung	6-Month PLN-WIBOR	5,430	16.03.2028		6.700	12	0,00
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR	5,460	16.08.2027		1.300	(25)	(0,01)
Zahlung	6-Month PLN-WIBOR	5,490	12.12.2027		19.700	211	0,07
Zahlung	6-Month PLN-WIBOR	5,525	12.12.2027		6.500	72	0,02
Zahlung	6-Month PLN-WIBOR	5,540	01.06.2028		26.600	(1)	0,00
Zahlung	6-Month PLN-WIBOR	5,670	09.12.2027		19.500	247	0,08
Zahlung	6-Month PLN-WIBOR	5,750	08.12.2027		16.300	221	0,07
Zahlung	6-Month PLN-WIBOR	5,800	07.12.2027		32.600	457	0,15
Zahlung	6-Month PLN-WIBOR	5,830	08.12.2027		32.600	470	0,16
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR	6,160	23.02.2028		42.600	(449)	(0,15)
Zahlung	6-Month PLN-WIBOR	6,310	18.11.2027		14.800	286	0,09
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR	6,348	09.09.2027		14.800	(277)	(0,09)
Zahlung	6-Month PLN-WIBOR	6,365	17.11.2027		15.600	310	0,10
Zahlung	6-Month PLN-WIBOR	6,455	16.11.2027		23.630	493	0,16
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR	6,650	29.09.2027		33.200	(899)	(0,30)
Zahlung	6-Month PLN-WIBOR	7,223	29.06.2027		23.200	319	0,11
Erhalt	6-Month PLN-WIBOR	7,726	24.10.2027		87.700	(2.886)	(0,95)
Zahlung	6-Month PLN-WIBOR	7,761	21.10.2027		7.052	239	0,08
Erhalt	6-Month TWD-TAIBOR	1,250	15.03.2028	TWD	861.000	3	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	4,775	26.06.2025	MXN	4.900	27	0,01
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	4,800	05.02.2026		65.500	336	0,11
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	5,080	09.10.2025		14.500	(91)	(0,03)
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	5,095	30.10.2025		23.500	(149)	(0,05)
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	5,120	06.05.2025		15.800	(95)	(0,03)
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	5,443	17.04.2025		5.700	(35)	(0,01)
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	5,550	12.03.2026		32.800	171	0,06
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	6,050	04.06.2026		22.600	(104)	(0,03)
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	6,095	20.03.2026		51.800	231	0,08
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	6,210	28.03.2025		4.300	(29)	(0,01)
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	6,230	07.04.2025		16.700	(118)	(0,04)
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	6,255	21.05.2026		23.500	98	0,03

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	6,460 %	18.06.2026	MXN 43.000	$ 159	0,05
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	6,625	11.09.2026	21.100	78	0,03
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	6,635	11.09.2026	21.100	77	0,03
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	6,740	17.09.2026	28.500	98	0,03
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	7,109	03.12.2026	102.300	(296)	(0,10)
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	7,113	24.09.2026	134.600	403	0,13
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	7,264	17.12.2026	30.000	82	0,03
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	7,273	12.11.2026	33.880	(87)	(0,03)
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	7,353	05.11.2026	58.150	145	0,05
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	7,370	14.10.2026	24.200	(59)	(0,02)
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	7,383	28.01.2027	29.500	71	0,02
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	7,460	04.02.2027	44.800	(99)	(0,03)
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	7,530	14.01.2027	24.100	54	0,02
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	7,590	29.10.2026	40.000	85	0,03
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	7,673	31.12.2026	23.900	45	0,02
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	7,745	11.02.2027	53.100	(97)	(0,03)
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	8,055	13.06.2033	57.100	(29)	(0,01)
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	8,207	19.06.2028	135.000	(44)	(0,01)
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	8,250	02.12.2032	85.900	17	0,01
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	8,280	29.07.2027	40.300	(38)	(0,01)
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	8,281	28.03.2033	68.000	44	0,01
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	8,340	21.04.2033	35.500	(57)	(0,02)
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	8,374	14.03.2033	135.600	146	0,05
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	8,400	21.05.2027	47.400	(19)	(0,01)
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	8,402	20.05.2027	34.800	(14)	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	8,438	20.03.2028	307.500	22	0,01
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	8,453	30.11.2027	332.600	(10)	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	8,480	30.11.2027	105.200	3	0,00
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	8,498	11.03.2027	25.400	(10)	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	8,563	16.05.2033	31.700	(59)	(0,02)
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	8,616	05.11.2027	165.400	48	0,02
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	8,620	09.11.2027	82.900	55	0,02
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	8,728	22.05.2028	135.300	(116)	(0,04)
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	8,740	30.08.2027	30.800	(19)	(0,01)
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	8,755	03.02.2033	45.900	(114)	(0,04)
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	8,785	06.05.2027	24.900	(6)	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	8,800	02.02.2033	73.500	(195)	(0,06)
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	8,810	01.07.2027	60.100	24	0,01
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	8,844	07.02.2033	104.900	(299)	(0,10)
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	8,921	25.08.2027	61.100	(34)	(0,01)
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	8,940	07.02.2028	136.200	(146)	(0,05)
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	9,020	03.06.2027	91.300	(78)	(0,03)
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	9,060	14.09.2027	61.100	(75)	(0,02)
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	9,070	24.06.2027	13.500	(13)	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	9,114	24.06.2027	11.700	(12)	0,00
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	9,215	09.02.2028	146.800	(250)	(0,08)
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	9,290	23.09.2027	22.500	35	0,01
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	9,295	21.10.2027	116.100	(191)	(0,06)
Zahlung	28-Day MXN-TIIE	9,300	24.09.2027	34.400	54	0,02
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	9,345	16.02.2028	99.400	(202)	(0,07)
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	9,382	12.10.2027	153.800	(289)	(0,10)
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	9,390	07.10.2027	40.300	(74)	(0,02)
Erhalt	28-Day MXN-TIIE	9,536	22.09.2027	67.800	(140)	(0,05)
Zahlung	CPURNSA	2,525	07.06.2033	$ 4.200	(10)	0,00
					$ (5.452)	(1,81)
Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate					**$ (5.126)**	**(1,70)**

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

(2) Der maximal mögliche Betrag, den der Fonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

(3) Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft.

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

*** Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt**

OPTIONSKAUF

DEVISENOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag[1]	Kosten	Markt-wert	% des Nettovermögens
DUB	Put - OTC USD versus JPY	¥ 125,000	25.07.2023	20.000	$ 2	$ 1	0,00
RBC	Call - OTC USD versus CAD	CAD 1,383	20.07.2023	6.000	1	0	0,00
					$ 3	$ 1	0,00

(1) Der Nennbetrag stellt die Anzahl der Kontrakte dar.

ZINSSWAPS

Kontrahent	Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits-datum		Nenn-betrag	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Markt-wert	% des Nettovermögens
BOA	Erhalt	3-Month MYR-KLIBOR	3,500 %	15.03.2028	MYR	55.000	$ (47)	$ 129	$ 82	0,03
	Zahlung	3-Month MYR-KLIBOR	3,750	21.12.2027		143.400	98	30	128	0,04
	Erhalt	3-Month MYR-KLIBOR	3,750	15.03.2028		125.700	(76)	(36)	(112)	(0,04)
GLM	Erhalt	3-Month MYR-KLIBOR	3,500	15.03.2028		5.100	6	2	8	0,00
	Zahlung	3-Month MYR-KLIBOR	3,750	15.03.2028		55.300	169	(120)	49	0,02
	Erhalt	3-Month MYR-KLIBOR	4,000	21.12.2027		39.700	131	(256)	(125)	(0,04)
GST	Erhalt	3-Month MYR-KLIBOR	3,500	15.03.2028		24.800	23	14	37	0,01
	Zahlung	3-Month MYR-KLIBOR	3,750	21.12.2027		86.500	103	(26)	77	0,03
	Erhalt	3-Month MYR-KLIBOR	3,750	15.03.2028		49.800	(1)	(44)	(45)	(0,02)
	Erhalt	3-Month MYR-KLIBOR	4,000	21.12.2027		47.600	101	(251)	(150)	(0,05)
JPM	Zahlung	3-Month MYR-KLIBOR	3,750	21.12.2027		40.300	46	(10)	36	0,01
MYC	Zahlung	3-Month MYR-KLIBOR	4,250	21.12.2027		38.980	13	198	211	0,07
SCX	Erhalt	3-Month MYR-KLIBOR	3,750	15.03.2028		2.100	(3)	1	(2)	0,00
	Zahlung	3-Month MYR-KLIBOR	3,750	15.03.2028		33.500	29	1	30	0,01
							$ 592	$ (368)	$ 224	0,07

TOTAL RETURN SWAPS AUF INDIZES

Kontrahent	Zahlung/Erhalt	Wertpapier	Anzahl der Anteile oder Einheiten	Variabler Zinssatz		Nenn-betrag	Fälligkeits-datum	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Markt-wert	% des Nettovermögens
MEI	Erhalt	BOVESPA Index	195	0,000 %	BRL	23.509	16.08.2023	$ 0	$ (28)	$ (28)	(0,01)
	Erhalt	KOSPI2 Index	32.000.000	0,000	KRW	11.068.163	14.09.2023	0	(131)	(131)	(0,04)
	Zahlung	Thailand Equity Index	270.400	0,000	THB	244.719	28.09.2023	0	(73)	(73)	(0,03)
								$ 0	$ (232)	$ (232)	(0,08)

DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung		Zu erhaltende Währung		Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
AZD	07.2023	$	3.216	¥	431.000	$ 0	$ (232)	$ (232)	(0,08)
	08.2023		6.410	AUD	9.562	0	(37)	(37)	(0,01)
BOA	07.2023	CLP	92.793	$	115	0	(1)	(1)	0,00
	07.2023	IDR	61.808.103		4.131	9	0	9	0,00
	07.2023	PLN	1.643		397	0	(7)	(7)	0,00
	07.2023	TRY	3.063		138	21	0	21	0,01
	07.2023	$	6	CZK	121	0	0	0	0,00
	07.2023		4.113	IDR	61.808.103	9	0	9	0,00
	07.2023		279	PLN	1.172	9	0	9	0,00
	07.2023		77	TRY	1.837	0	(7)	(7)	0,00
	08.2023	AUD	37.031	$	25.029	352	(2)	350	0,12
	08.2023	CAD	4.164		3.102	0	(46)	(46)	(0,02)
	08.2023	£	1.721		2.151	0	(39)	(39)	(0,01)
	08.2023	¥	1.786.900		12.893	451	0	451	0,15
	08.2023	NZD	19.475		12.129	200	0	200	0,07
	08.2023	SEK	69.738		6.783	314	0	314	0,10
	08.2023	$	859	AUD	1.306	14	(2)	12	0,00
	08.2023		708	CAD	940	3	0	3	0,00
	08.2023		3.297	€	3.066	55	0	55	0,02
	08.2023		126	£	101	2	0	2	0,00
	08.2023		122	¥	16.400	0	(8)	(8)	0,00
	08.2023		19	SEK	205	0	0	0	0,00
	08.2023	ZAR	7.012	$	372	4	(2)	2	0,00
	09.2023	HKD	12.697		1.625	2	0	2	0,00
	09.2023	IDR	24.088.000		1.600	0	0	0	0,00
	09.2023	INR	1.929.851		23.480	22	0	22	0,01
	09.2023	KRW	640.033		505	17	0	17	0,01
	09.2023	TWD	45.097		1.487	36	0	36	0,01
	09.2023	$	4.131	IDR	61.857.680	0	(23)	(23)	(0,01)
	11.2023		28	ILS	100	0	0	0	0,00
BPS	07.2023	BRL	11.493	$	2.340	0	(42)	(42)	(0,01)
	07.2023	PLN	460		107	0	(6)	(6)	0,00
	07.2023	SGD	614		463	9	0	9	0,00
	07.2023	TRY	329		14	2	0	2	0,00
	07.2023	$	4	CLP	2.938	0	0	0	0,00
	07.2023		63	COP	262.528	0	(1)	(1)	0,00
	07.2023		5.634	CZK	120.532	0	(103)	(103)	(0,03)
	07.2023		380	PLN	1.586	10	0	10	0,00
	07.2023		15	SGD	20	0	0	0	0,00
	07.2023		9	TRY	196	0	(1)	(1)	0,00
	08.2023	AUD	487	$	331	7	0	7	0,00
	08.2023	CAD	1.757		1.300	0	(29)	(29)	(0,01)
	08.2023	CHF	17.730		20.073	170	0	170	0,06
	08.2023	CNH	7.386		1.069	50	0	50	0,02
	08.2023	€	6.600		7.122	6	(100)	(94)	(0,03)
	08.2023	SEK	2.655		248	2	0	2	0,00
	08.2023	TWD	23.310		763	15	0	15	0,01

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung		Zu erhaltende Währung		Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
	08.2023	$	1.045	AUD	1.538	$ 0	$ (20)	$ (20)	(0,01)
	08.2023		524	€	486	7	0	7	0,00
	08.2023		334	¥	46.300	0	(12)	(12)	0,00
	08.2023		2.502	MXN	43.559	17	0	17	0,01
	08.2023		95	ZAR	1.776	0	(2)	(2)	0,00
	08.2023	ZAR	888	$	46	0	0	0	0,00
	09.2023	AUD	3.700		2.449	0	(19)	(19)	(0,01)
	09.2023	BRL	5.970		1.200	0	(21)	(21)	(0,01)
	09.2023	CLP	940.367		1.151	0	(10)	(10)	0,00
	09.2023	COP	262.528		62	1	0	1	0,00
	09.2023	¥	627.327		4.500	108	0	108	0,04
	09.2023	KRW	2.750.742		2.137	40	0	40	0,01
	09.2023	PLN	14.040		3.300	0	(143)	(143)	(0,05)
	09.2023	RON	11.139		2.400	0	(45)	(45)	(0,01)
	09.2023	SEK	13.610		1.258	0	(7)	(7)	0,00
	09.2023	THB	641.340		18.621	395	0	395	0,13
	09.2023	$	6.791	AUD	10.000	0	(120)	(120)	(0,04)
	09.2023		1.300	BRL	6.416	12	0	12	0,00
	09.2023		12.500	CAD	16.638	88	0	88	0,03
	09.2023		1.300	COP	5.885.100	81	0	81	0,03
	09.2023		5.349	€	4.875	0	(10)	(10)	0,00
	09.2023		13.728	£	10.688	0	(138)	(138)	(0,05)
	09.2023		910	HUF	313.488	0	(10)	(10)	0,00
	09.2023		5.583	ILS	19.917	0	(201)	(201)	(0,07)
	09.2023		9.100	KRW	11.708.485	0	(176)	(176)	(0,06)
	09.2023		5.225	NZD	8.400	0	(80)	(80)	(0,03)
	09.2023		1.400	PLN	5.722	3	0	3	0,00
	09.2023		3.311	RON	15.030	0	(12)	(12)	0,00
	09.2023		14.406	THB	493.710	0	(377)	(377)	(0,12)
	09.2023		5.364	ZAR	99.481	0	(139)	(139)	(0,05)
	12.2023	MXN	383.334	$	21.501	0	(187)	(187)	(0,06)
BRC	07.2023	CZK	52.677		2.384	0	(34)	(34)	(0,01)
	07.2023	¥	1.370.000		10.592	1.096	0	1.096	0,36
	07.2023	MYR	66.031		14.392	218	0	218	0,07
	07.2023	SGD	453		337	3	0	3	0,00
	07.2023	TRY	1.434		60	5	0	5	0,00
	07.2023	$	6.480	PLN	26.895	134	0	134	0,04
	07.2023		1.771	RON	8.150	21	0	21	0,01
	07.2023		56	SGD	75	0	(1)	(1)	0,00
	08.2023	COP	3.274.264	$	769	0	(6)	(6)	0,00
	08.2023	£	15.617		19.487	0	(373)	(373)	(0,12)
	08.2023	HUF	686.424		1.978	0	(5)	(5)	0,00
	08.2023	¥	322.368		2.436	191	0	191	0,06
	08.2023	$	17.159	CNH	122.253	0	(300)	(300)	(0,10)
	08.2023		4.353	€	4.015	36	0	36	0,01
	08.2023		538	£	427	6	(1)	5	0,00
	08.2023		90	¥	12.200	0	(5)	(5)	0,00
	08.2023		78	MXN	1.352	0	0	0	0,00
	08.2023		156	ZAR	3.021	4	(1)	3	0,00
	08.2023	ZAR	1.299	$	68	0	(1)	(1)	0,00
	09.2023	HKD	7.899		1.011	1	0	1	0,00
	09.2023	ILS	14.703		4.137	164	0	164	0,05
	09.2023	SGD	2.683		2.009	21	0	21	0,01
	09.2023	$	113	HKD	886	0	0	0	0,00
	09.2023		2.000	ILS	7.236	0	(45)	(45)	(0,01)
	09.2023		3.300	KRW	4.275.150	0	(42)	(42)	(0,01)
CBK	07.2023	BRL	12.668	$	2.640	14	0	14	0,01
	07.2023	€	1.272		1.365	0	(23)	(23)	(0,01)
	07.2023	IDR	47.763.202		3.179	0	(7)	(7)	0,00
	07.2023	MXN	1.059		59	0	(3)	(3)	0,00
	07.2023	RON	14.639		3.238	19	0	19	0,01
	07.2023	TRY	1.924		85	11	0	11	0,00
	07.2023	$	1.763	CLP	1.426.848	14	0	14	0,00
	07.2023		646	CZK	13.928	0	(7)	(7)	0,00
	07.2023		3.179	IDR	47.763.202	7	0	7	0,00
	07.2023		18.900	INR	1.551.407	0	(6)	(6)	0,00
	07.2023		16.672	PHP	909.467	0	(230)	(230)	(0,08)
	07.2023		33	PLN	133	0	0	0	0,00
	08.2023	CAD	1.688	$	1.254	0	(23)	(23)	(0,01)
	08.2023	CLP	2.024.098		2.474	0	(31)	(31)	(0,01)
	08.2023	CNH	220.848		31.676	1.220	0	1.220	0,40
	08.2023	¥	339.412		2.554	191	0	191	0,06
	08.2023	NOK	8.659		830	21	0	21	0,01
	08.2023	SEK	22.976		2.266	134	0	134	0,04
	08.2023	TWD	55.070		1.804	36	0	36	0,01
	08.2023	$	173	AUD	262	2	0	2	0,00
	08.2023		13.266	CLP	10.669.473	0	(23)	(23)	(0,01)
	08.2023		579	€	538	10	0	10	0,00
	08.2023		27.504	£	21.737	138	0	138	0,05
	08.2023		698	¥	95.800	0	(31)	(31)	(0,01)
	08.2023		73	SEK	765	0	(2)	(2)	0,00
	08.2023		2.757	TWD	84.415	0	(47)	(47)	(0,02)

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung		Zu erhaltende Währung		Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
	08.2023	$	169	ZAR	3.177	$ 0	$ (2)	$ (2)	0,00
	09.2023	COP	6.025.600	$	1.400	0	(14)	(14)	0,00
	09.2023	IDR	21.721		1	0	0	0	0,00
	09.2023	INR	62.165		756	1	0	1	0,00
	09.2023	MXN	26.102		1.500	0	0	0	0,00
	09.2023	PEN	38.818		10.548	0	(97)	(97)	(0,03)
	09.2023	SEK	13.203		1.221	0	(6)	(6)	0,00
	09.2023	$	2.611	BRL	12.668	0	(14)	(14)	0,00
	09.2023		4.259	IDR	63.902.621	0	(15)	(15)	(0,01)
	09.2023		13	ILS	48	0	0	0	0,00
	09.2023		4.260	NOK	44.774	0	(70)	(70)	(0,02)
	09.2023	ZAR	12.167	$	658	19	0	19	0,01
	10.2023	$	1.187	CLP	969.447	7	0	7	0,00
	11.2023	ILS	98	$	30	3	0	3	0,00
	04.2024		100		28	0	0	0	0,00
DUB	07.2023	MXN	35.716		2.080	1	0	1	0,00
	07.2023	$	844	BRL	4.570	104	0	104	0,03
	07.2023		133	CZK	2.947	2	0	2	0,00
	08.2023	€	920	$	1.004	0	(1)	(1)	0,00
	08.2023	$	22.495	CHF	20.171	149	0	149	0,05
	08.2023		302	£	243	7	0	7	0,00
	08.2023		34	SEK	360	0	0	0	0,00
	08.2023		34	ZAR	647	0	0	0	0,00
	09.2023		3.360	HUF	1.156.833	0	(39)	(39)	(0,01)
FAR	07.2023		1.828	CLP	1.450.837	0	(21)	(21)	(0,01)
	08.2023		51	£	41	1	0	1	0,00
GLM	07.2023	COP	24.235.035	$	5.742	0	(48)	(48)	(0,02)
	07.2023	PHP	102		2	0	0	0	0,00
	07.2023	PLN	1.686		397	0	(17)	(17)	(0,01)
	07.2023	SGD	5.942		4.476	83	0	83	0,03
	07.2023	$	803	BRL	4.293	87	0	87	0,03
	07.2023		8	RON	36	0	0	0	0,00
	08.2023	CHF	2.217	$	2.505	16	0	16	0,01
	08.2023	NOK	16.616		1.566	13	0	13	0,00
	09.2023	BRL	33		6	0	0	0	0,00
	09.2023	SGD	406		304	3	0	3	0,00
	09.2023	$	10.190	BRL	51.385	344	0	344	0,11
	09.2023		1.476	MXN	25.802	6	0	6	0,00
	09.2023		147	SGD	196	0	(1)	(1)	0,00
	10.2023	MXN	20.762	$	1.183	0	(5)	(5)	0,00
IND	07.2023	$	28.296	¥	3.784.000	0	(2.041)	(2.041)	(0,67)
	07.2023		41	SGD	55	0	0	0	0,00
	08.2023	£	1.710	$	2.135	0	(40)	(40)	(0,01)
	08.2023	NOK	6.834		652	13	0	13	0,00
JPM	07.2023		431		25	0	0	0	0,00
	07.2023	SGD	2.086		1.579	37	0	37	0,01
	07.2023	TRY	6.350		276	34	0	34	0,01
	07.2023	$	1.089	PHP	59.517	0	(13)	(13)	0,00
	07.2023		62	PLN	264	3	0	3	0,00
	07.2023		22	SGD	30	0	0	0	0,00
	07.2023		178	TRY	4.085	0	(22)	(22)	(0,01)
	08.2023	CAD	2.631	$	1.968	0	(22)	(22)	(0,01)
	08.2023	CNH	18.874		2.731	128	0	128	0,04
	08.2023	€	1.034		1.139	9	0	9	0,00
	08.2023	£	760		962	0	(4)	(4)	0,00
	08.2023	¥	339.295		2.554	192	0	192	0,06
	08.2023	MXN	2.041		118	0	0	0	0,00
	08.2023	NOK	22.739		2.144	18	0	18	0,01
	08.2023	$	68	AUD	102	0	0	0	0,00
	08.2023		1.246	CAD	1.687	30	0	30	0,01
	08.2023		228	€	211	2	0	2	0,00
	08.2023		1.094	£	875	21	(2)	19	0,01
	08.2023		6.111	HUF	2.106.276	2	(28)	(26)	(0,01)
	08.2023		12	¥	1.600	0	(1)	(1)	0,00
	08.2023		8.951	NZD	14.500	0	(70)	(70)	(0,02)
	09.2023	CHF	9.615	$	10.700	0	(134)	(134)	(0,04)
	09.2023	COP	1.109.099		261	1	0	1	0,00
	09.2023	CZK	26.554		1.200	0	(15)	(15)	(0,01)
	09.2023	HKD	4.038		517	1	0	1	0,00
	09.2023	IDR	47.568.000		3.200	40	0	40	0,01
	09.2023	ILS	3.629		1.022	41	0	41	0,01
	09.2023	INR	133.502		1.620	0	(3)	(3)	0,00
	09.2023	PHP	619.377		11.014	0	(164)	(164)	(0,05)
	09.2023	SEK	13.206		1.221	0	(6)	(6)	0,00
	09.2023	THB	177.650		5.109	61	0	61	0,02
	09.2023	$	1.377	AUD	2.000	0	(42)	(42)	(0,01)
	09.2023		1.187	BRL	5.998	43	0	43	0,01
	09.2023		1.700	CLP	1.386.180	12	0	12	0,00
	09.2023		30	HUF	10.325	0	0	0	0,00
	09.2023		1.075	IDR	16.138.617	0	(3)	(3)	0,00
	09.2023		1.000	ILS	3.549	0	(41)	(41)	(0,01)
	09.2023		7.123	INR	589.620	44	0	44	0,01

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung		Zu erhaltende Währung		Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
	09.2023	$	2.003	KRW	2.538.382	$ 0	$ (68)	$ (68)	(0,02)
	09.2023		1.600	MXN	28.316	27	0	27	0,01
	09.2023		1.540	NOK	16.154	0	(28)	(28)	(0,01)
	09.2023		20.139	PEN	74.151	195	0	195	0,06
	09.2023		2	PHP	133	0	0	0	0,00
	09.2023		60	SGD	80	0	(1)	(1)	0,00
	09.2023		2.136	ZAR	40.075	0	(31)	(31)	(0,01)
MBC	07.2023	CZK	4.349	$	202	2	0	2	0,00
	07.2023	£	736		911	0	(25)	(25)	(0,01)
	07.2023	¥	3.784.000		28.974	2.720	0	2.720	0,90
	07.2023	PLN	12.381		2.899	0	(146)	(146)	(0,05)
	07.2023	$	5.961	¥	850.000	0	(69)	(69)	(0,02)
	07.2023		53	PLN	219	1	0	1	0,00
	07.2023		140	SGD	188	0	(1)	(1)	0,00
	08.2023	€	800	$	883	8	0	8	0,00
	08.2023	TWD	286.896		9.385	171	0	171	0,06
	08.2023	$	3.011	AUD	4.425	0	(62)	(62)	(0,02)
	08.2023		21.100	CAD	28.022	90	0	90	0,03
	09.2023	KRW	2.078.511	$	1.630	46	0	46	0,02
	09.2023	$	109	HKD	854	0	0	0	0,00
MYI	07.2023	CZK	7.881	$	358	1	(4)	(3)	0,00
	07.2023	IDR	3.527.922		236	1	0	1	0,00
	07.2023	INR	1.551.690		18.900	2	0	2	0,00
	07.2023	MYR	22.010		4.781	57	0	57	0,02
	07.2023	TRY	6.741		277	20	0	20	0,01
	07.2023	$	20	CZK	425	0	0	0	0,00
	07.2023		13	€	12	0	0	0	0,00
	07.2023		539	£	427	4	0	4	0,00
	07.2023		235	IDR	3.527.922	1	0	1	0,00
	07.2023		9.602	MYR	44.219	0	(111)	(111)	(0,04)
	07.2023		825	PLN	3.480	31	0	31	0,01
	07.2023		23	TRY	597	0	0	0	0,00
	08.2023	CAD	393	$	295	0	(3)	(3)	0,00
	08.2023	¥	140.647		1.058	79	0	79	0,03
	08.2023	NOK	27.285		2.577	26	0	26	0,01
	08.2023	SEK	4.010		374	2	0	2	0,00
	08.2023	TWD	30.532		1.002	22	0	22	0,01
	08.2023	$	539	CAD	719	4	0	4	0,00
	08.2023		42	€	39	0	0	0	0,00
	08.2023		926	¥	128.000	0	(35)	(35)	(0,01)
	08.2023		196	SEK	2.105	0	(1)	(1)	0,00
	09.2023	BRL	4.919	$	1.000	0	(6)	(6)	0,00
	09.2023	ILS	29.483		8.218	251	0	251	0,08
	09.2023	KRW	4.418.771		3.453	85	0	85	0,03
	09.2023	THB	151.234		4.339	41	0	41	0,01
	09.2023	TRY	3.180		119	0	0	0	0,00
	09.2023	$	6.900	CAD	9.118	8	(9)	(1)	0,00
	09.2023		35	HKD	273	0	0	0	0,00
	09.2023		236	IDR	3.530.989	0	(1)	(1)	0,00
	09.2023		19.790	INR	1.628.172	2	(1)	1	0,00
	09.2023		1.800	MXN	31.471	8	0	8	0,00
	09.2023	ZAR	40.005	$	2.149	48	0	48	0,02
RBC	07.2023	$	33.700	MXN	648.426	4.043	0	4.043	1,34
	07.2023		148	SGD	200	0	0	0	0,00
	08.2023	CAD	28.835	$	21.364	0	(442)	(442)	(0,15)
	08.2023	£	1.271		1.606	0	(10)	(10)	0,00
	08.2023	¥	2.354.758		17.524	1.128	0	1.128	0,37
	08.2023	$	83	AUD	123	0	(1)	(1)	0,00
	08.2023		45	€	41	0	0	0	0,00
	08.2023		224	£	180	4	0	4	0,00
	08.2023		148	MXN	2.566	0	0	0	0,00
RYL	07.2023	PLN	7.368	$	1.738	0	(74)	(74)	(0,02)
	08.2023	SEK	1.820		168	0	0	0	0,00
	08.2023	$	88	AUD	132	0	0	0	0,00
	08.2023		60	SEK	635	0	(1)	(1)	0,00
SCX	07.2023	SGD	1.949	$	1.441	0	0	0	0,00
	07.2023	TRY	4.527		195	23	0	23	0,01
	07.2023	$	2.032	PLN	8.649	95	0	95	0,03
	08.2023	AUD	19.492	$	13.065	83	(8)	75	0,03
	08.2023	CNH	12.802		1.861	95	0	95	0,03
	08.2023	€	1.839		2.013	2	0	2	0,00
	08.2023	£	534		676	0	(3)	(3)	0,00
	08.2023	NZD	3.425		2.138	40	0	40	0,01
	08.2023	SEK	15.610		1.465	17	0	17	0,01
	08.2023	TWD	18.509		606	12	0	12	0,00
	08.2023	$	159	AUD	238	0	0	0	0,00
	08.2023		962	€	890	11	0	11	0,00
	08.2023		3.858	£	3.095	78	0	78	0,03
	08.2023		441	NOK	4.685	0	(3)	(3)	0,00
	08.2023		99	SEK	1.030	0	(4)	(4)	0,00
	09.2023	INR	85.880	$	1.043	0	(1)	(1)	0,00
	09.2023	THB	98.370		2.831	36	0	36	0,01
	09.2023	TWD	211.516		6.938	132	0	132	0,04
	09.2023	$	18.310	INR	1.505.832	0	(6)	(6)	0,00
SOG	07.2023	PLN	3.511	$	815	0	(48)	(48)	(0,02)
	07.2023	SGD	145		109	2	0	2	0,00
	07.2023	$	1.229	SGD	1.649	0	(10)	(10)	0,00

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung		Zu erhaltende Währung		Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
	08.2023	$	77	SEK	840	$ 0	$ 0	$ 0	0,00
SSB	07.2023		3.046	BRL	15.298	126	0	126	0,04
	07.2023		115	CLP	92.793	0	0	0	0,00
	07.2023		15.353	COP	68.133.777	964	0	964	0,32
	08.2023	CLP	34.068.674	$	42.019	0	(303)	(303)	(0,10)
	09.2023		1.100.110		1.349	0	(10)	(10)	0,00
	09.2023	$	39.508	CLP	31.930.100	0	(48)	(48)	(0,02)
	10.2023	CLP	92.793	$	114	0	0	0	0,00
TOR	07.2023	COP	69.311.116		16.709	121	(10)	111	0,04
	07.2023	$	16.501	COP	68.954.036	0	(98)	(98)	(0,03)
	07.2023		50	CZK	1.077	0	0	0	0,00
	07.2023		935	£	736	0	0	0	0,00
	07.2023		151	PLN	642	7	0	7	0,00
	08.2023	€	336	$	367	0	(1)	(1)	0,00
	08.2023	£	1.597		2.014	0	(17)	(17)	(0,01)
	08.2023	¥	167.426		1.263	97	0	97	0,03
	08.2023	$	1.934	CLP	1.552.352	0	(8)	(8)	0,00
	08.2023		21	£	17	0	0	0	0,00
	08.2023		62	SEK	670	0	0	0	0,00
	09.2023	ILS	20.507	$	5.782	241	0	241	0,08
	09.2023	$	52	ILS	185	0	(2)	(2)	0,00
	09.2023		134	SGD	180	0	(1)	(1)	0,00
UAG	07.2023	CZK	1.724	$	78	0	(1)	(1)	0,00
	07.2023	¥	431.000		3.288	304	0	304	0,10
	07.2023	TRY	29.091		1.278	170	0	170	0,06
	07.2023	$	17	CZK	362	0	0	0	0,00
	07.2023		1.406	TRY	32.420	0	(171)	(171)	(0,06)
	08.2023	CAD	419	$	319	2	0	2	0,00
	08.2023	€	1.084		1.190	5	0	5	0,00
	08.2023	£	429		542	0	(3)	(3)	0,00
	08.2023	¥	1.360.000		10.033	577	0	577	0,19
	08.2023	$	150	€	140	3	0	3	0,00
	08.2023		501	£	396	2	0	2	0,00
	08.2023		1.831	HUF	638.347	13	0	13	0,00
	08.2023		1	TWD	43	0	0	0	0,00
	08.2023	ZAR	67.072	$	3.478	1	(59)	(58)	(0,02)
	09.2023	ILS	3.682		1.028	33	0	33	0,01
	09.2023	$	2.889	RON	13.121	0	(8)	(8)	0,00
						$ 20.258	$ (8.618)	$ 11.640	3,8

ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklassen Institutional EUR (Hedged) thesaurierend, Investor EUR (Hedged) thesaurierend und Class E EUR (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung		Zu erhaltende Währung		Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2023	€	204	$	221	$ 0	$ (1)	$ (1)	0,00
	07.2023	$	16.469	€	15.324	250	0	250	0,08
BPS	07.2023	€	15.732	$	17.238	74	0	74	0,02
	07.2023	$	17.543	€	16.307	249	(2)	247	0,08
	08.2023		17.218		15.692	0	(73)	(73)	(0,02)
CBK	07.2023	€	16.073	$	17.476	1	(61)	(60)	(0,02)
	07.2023	$	664	€	619	11	0	11	0,00
	08.2023		17.176		15.776	59	0	59	0,02
JPM	07.2023	€	15.776	$	17.225	14	0	14	0,01
	08.2023	$	17.250	€	15.776	0	(15)	(15)	0,00
MBC	07.2023	€	322	$	346	0	(6)	(6)	0,00
	07.2023	$	458	€	427	8	0	8	0,00
SOG	07.2023		16.778		15.597	238	0	238	0,08
						$ 904	$ (158)	$ 746	0,25

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklassen Institutional GBP (Hedged) thesaurierend und Institutional GBP (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung		Zu erhaltende Währung		Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BRC	07.2023	£	2.565	$	3.266	$ 5	$ (1)	$ 4	0,00
	07.2023	$	1.064	£	854	22	0	22	0,01
CBK	07.2023	£	24	$	31	0	0	0	0,00
MBC	07.2023		2.372		3.017	1	0	1	0,00
	07.2023	$	28.971	£	23.403	783	0	783	0,26
MYI	07.2023	£	106	$	131	0	(3)	(3)	0,00
	07.2023	$	29.076	£	23.394	666	0	666	0,22
UAG	07.2023		29.959		24.027	594	(5)	589	0,19
						$ 2.071	$ (9)	$ 2.062	0,68

Summe Freiverkehrsfinanzderivate	**$ 14.441**	**4,77**

LEERVERKAUFTE WERTPAPIERE

BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
US-REGIERUNGSBEHÖRDEN			
Ginnie Mae, TBA			
5,500 % fällig am 01.08.2053	$ 17.200	$ (17.113)	(5,66)
Uniform Mortgage-Backed Security, TBA			
4,500 % fällig am 01.07.2038	4.800	(4.707)	(1,55)
5,500 % fällig am 01.07.2053 (d)	2.850	(2.836)	(0,94)
5,500 % fällig am 01.08.2053	3.000	(2.985)	(0,99)
6,000 % fällig am 01.07.2053	160	(161)	(0,05)
6,000 % fällig am 01.08.2053	3.740	(3.773)	(1,25)
Summe Leerverkaufte Wertpapiere		**$ (31.575)**	**(10,44)**
Summe Anlagen		**$ 253.207**	**83,74**
Sonstige Aktiva und Passiva		**$ 49.157**	**16,26**
Nettovermögen		**$ 302.364**	**100,00**

ERLÄUTERUNGEN ZUR AUFSTELLUNG DES WERTPAPIERBESTANDS (Angaben in Tausend*):

*** Auf Null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt.**

(a) Nullkuponwertpapier.

(b) Der Kupon stellt eine Rendite bis zur Endfälligkeit dar.

(c) Mit dem Fonds verbunden.

(d) Zum 30. Juni 2023 leerverkaufter Wertpapier ist durch langfristige Portfolioanlagen in übertragbaren Wertpapieren und Geldmarktinstrumenten abgedeckt.

(e) Eingeschränkte Wertpapiere (31. Dezember 2022: 0,21 %):

Emittentenbeschreibung	Kupon	Fälligkeits-datum	Kauf-datum	Kosten	Markt-wert	% des Nettovermögens
DBS Bank Ltd.	4,467 %	22.11.2023	06.02.2023	$ 4.805	$ 4.660	1,54
Deutsche Bank AG	0,898	28.05.2024	31.03.2022 - 31.05.2023	2.408	2.376	0,79
MUFG Bank Ltd.	4,883	21.12.2023	06.02.2023 - 08.02.2023	1.037	999	0,33
				$ 8.250	$ 8.035	2,66

Barmittel in Höhe von 26.089 USD (31. Dezember 2022: 21.987 USD) wurden zum 30. Juni 2023 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Barmittel in Höhe von 3.311 USD (31. Dezember 2022: 6.601 USD) wurden zum 30. Juni 2023 gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. als Sicherheit für Finanzderivate verpfändet.

Bewertung zum Marktwert[1]

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 30. Juni 2023 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie[2]	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	$ 0	$ 237.254	$ 0	$ 237.254
Investmentfonds	30.015	0	0	30.015
Pensionsgeschäfte	0	4.583	0	4.583
Finanzderivate[3]	2.979	9.951	0	12.930
Leerverkaufte Wertpapiere	0	(31.575)	0	(31.575)
Summen	**$ 32.994**	**$ 220.213**	**$ 0**	**$ 253.207**

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 31. Dezember 2022 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie[2]	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	$ 0	$ 335.879	$ 0	$ 335.879
Investmentfonds	10.879	30.814	0	41.693
Pensionsgeschäfte	0	27.452	0	27.452
Finanzderivate[3]	467	(2.020)	0	(1.553)
Einlagen bei Kreditinstituten	0	600	0	600
Summen	**$ 11.346**	**$ 392.725**	**$ 0**	**$ 404.071**

(1) Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 3 in den Erläuterungen zum Abschluss.

(2) Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung des Wertpapierbestands.

(3) Finanzderivate können offene Terminkontrakte, Swap-, Verkaufs- oder Kaufoptionen sowie Devisenterminkontrakte enthalten.

Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC-Finanzderivate und -Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2023 und 31. Dezember 2022:

	Zum 30. Jun. 2023			Zum 31. Dez. 2022		
Kontrahent	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-engagement[1]	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-engagement[1]
AZD	$ (269)	$ 270	$ 1	$ k. A.	$ k. A.	$ k. A.
BOA	1.730	(2.120)	(390)	(475)	490	15
BPS	(740)	920	180	(159)	380	221
BRC	1.112	(1.110)	2	(2.750)	2.340	(410)
CBK	1.206	(940)	266	1.779	(2.180)	(401)
CKL	k. A.	k. A.	k. A.	22	0	22
CLY	k. A.	k. A.	k. A.	157	0	157
DUB	224	(300)	(76)	k. A.	k. A.	k. A.
FAR	(20)	0	(20)	k. A.	k. A.	k. A.
GLM	413	(420)	(7)	(251)	330	79
GST	(81)	261	180	(299)	261	(38)
HUS	k. A.	k. A.	k. A.	267	(260)	7
IND	(2.068)	1.860	(208)	(8)	0	(8)
JPM	278	(290)	(12)	153	(390)	(237)
MBC	3.521	(3.370)	151	931	(880)	51
MEI	(232)	0	(232)	(165)	450	285
MYC	211	(280)	(69)	204	0	204
MYI	1.185	(890)	295	(99)	120	21
RBC	4.722	(4.670)	52	(69)	50	(19)
RYL	(75)	0	(75)	(21)	0	(21)
SCX	627	(690)	(63)	1.408	(1.310)	98
SOG	182	(280)	(98)	1	0	1
SSB	729	(740)	(11)	38	0	38
TOR	329	(280)	49	(1.737)	1.620	(117)
UAG	1.457	(1.260)	197	(761)	560	(201)

[1] Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären.

Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung des Wertpapierbestands zum 30. Juni 2023:

	30. Jun. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	45,34	28,54
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	33,13	48,50
Investmentfonds	9,93	9,56
Pensionsgeschäfte	1,52	6,30
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	1,19	0,13
Zentral abgerechnete Finanzderivate	(1,70)	(0,06)
Freiverkehrsfinanzderivate	4,77	(0,42)
Leerverkaufte Wertpapiere	(10,44)	k. A.
Einlagenzertifikate	k. A.	0,14

Das Anlageportfolio des Fonds konzentriert sich zum 30. Juni 2023 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	30. Jun. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
Unternehmensanleihen und Wechsel	55,27	39,15
Kommunalanleihen und Wechsel	k. A.	0,23
US-Regierungsbehörden	2,36	1,39
Non-Agency-MBS	0,62	0,45
Forderungsbesicherte Wertpapiere	4,21	1,06
Staatsemissionen	3,08	0,53
Kurzfristige Instrumente	12,93	34,23
Investmentfonds	9,93	9,56
Pensionsgeschäfte	1,52	6,30
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	1,19	0,13
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzverkauf	0,11	0,09
Zinsswaps	(1,81)	(0,15)
Freiverkehrsfinanzderivate		
Optionskauf		
Devisenoptionen	0,00	k. A.
Zinsswaps	0,07	0,04
Total Return Swaps auf Indizes	(0,08)	(0,04)
Devisenterminkontrakte	3,85	(1,20)
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	0,93	0,78
Einlagenzertifikate	k. A.	0,14
Leerverkaufte Wertpapiere	(10,44)	k. A.
Sonstige Aktiva und Passiva	16,26	7,31
Nettovermögen	100,00	100,00

Aufstellung des Wertpapierbestands des UK Corporate Bond Fund

BESCHREIBUNG		PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE				
AUSTRALIEN				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
BHP Billiton Finance Ltd.				
4,300 % fällig am 25.09.2042	£	500	£ 420	0,12
BELGIEN				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Sofina S.A.				
1,000 % fällig am 23.09.2028	€	400	275	0,08
KANADA				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Canadian Imperial Bank of Commerce				
5,881 % fällig am 15.12.2025	£	750	758	0,22
Royal Bank of Canada				
5,000 % fällig am 24.01.2028		1.700	1.597	0,48
			2.355	0,70
STAATSEMISSIONEN				
CPPIB Capital, Inc.				
6,000 % fällig am 07.06.2025 (a)		1.700	1.697	0,51
Summe Kanada			4.052	1,21
CAYMAN INSELN				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Trafford Centre Finance Ltd.				
4,750 % fällig am 28.04.2029		500	430	0,13
TSCHECHISCHE REPUBLIK				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
EP Infrastructure A/S				
1,659 % fällig am 26.04.2024	€	100	82	0,02
DÄNEMARK				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Danske Bank A/S				
4,625 % fällig am 13.04.2027	£	600	566	0,17
Orsted A/S				
2,500 % fällig am 16.05.2033		1.500	1.125	0,34
5,125 % fällig am 13.09.2034		1.400	1.308	0,39
Summe Dänemark			2.999	0,90
FRANKREICH				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
AXA S.A.				
5,453 % fällig am 04.03.2026 (d)		850	827	0,25
Banque Federative du Credit Mutuel S.A.				
4,875 % fällig am 25.09.2025		1.200	1.151	0,34
BNP Paribas S.A.				
1,250 % fällig am 13.07.2031		500	344	0,10
2,000 % fällig am 13.09.2036		800	502	0,15
2,875 % fällig am 24.02.2029		1.700	1.406	0,42
5,750 % fällig am 13.06.2032		1.100	1.045	0,31
Credit Agricole S.A.				
4,875 % fällig am 23.10.2029		700	652	0,20
5,750 % fällig am 29.11.2027		1.400	1.346	0,40
6,375 % fällig am 14.06.2031		700	690	0,21
Electricite de France S.A.				
5,125 % fällig am 22.09.2050		1.050	842	0,25
5,500 % fällig am 25.01.2035		1.200	1.073	0,32
5,500 % fällig am 27.03.2037		2.600	2.280	0,68
5,500 % fällig am 17.10.2041		1.000	862	0,26
6,125 % fällig am 02.06.2034		400	379	0,11
JCDecaux SE				
1,625 % fällig am 07.02.2030	€	200	141	0,04
Societe Generale S.A.				
6,250 % fällig am 22.06.2033	£	800	795	0,24
Summe Frankreich			14.335	4,28
DEUTSCHLAND				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Deutsche Bahn Finance GmbH				
1,875 % fällig am 13.02.2026		500	453	0,14
Deutsche Bank AG				
1,875 % fällig am 22.12.2028	£	1.700	£ 1.332	0,40
6,125 % fällig am 12.12.2030		200	184	0,05
Kreditanstalt fuer Wiederaufbau				
0,875 % fällig am 15.09.2026		900	778	0,23
1,125 % fällig am 04.07.2025		700	639	0,19
5,750 % fällig am 07.06.2032		400	431	0,13
			3.817	1,14
STAATSEMISSIONEN				
State of Saxony-Anhalt				
2,125 % fällig am 16.12.2024		600	567	0,17
Summe Deutschland			4.384	1,31
IRLAND				
FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE				
Toro European CLO DAC				
3,995 % fällig am 12.01.2032	€	3.600	3.030	0,90
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
GE Capital UK Funding Unlimited Co.				
5,875 % fällig am 18.01.2033	£	2.100	2.033	0,61
Summe Irland			5.063	1,51
ITALIEN				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
AMCO - Asset Management Co. SpA				
4,625 % fällig am 06.02.2027	€	500	427	0,13
Intesa Sanpaolo SpA				
6,625 % fällig am 20.06.2033	$	200	157	0,05
Nexi SpA				
2,125 % fällig am 30.04.2029	€	300	215	0,06
Summe Italien			799	0,24
JERSEY, KANALINSELN				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
CPUK Finance Ltd.				
5,876 % fällig am 28.08.2027	£	430	408	0,12
Gatwick Funding Ltd.				
2,500 % fällig am 15.04.2032		600	478	0,14
2,625 % fällig am 07.10.2048		200	114	0,04
5,750 % fällig am 23.01.2039		261	246	0,07
Heathrow Funding Ltd.				
2,750 % fällig am 13.10.2031		1.000	817	0,25
2,750 % fällig am 09.08.2051		1.800	1.050	0,31
HSBC Bank Capital Funding Sterling LP				
5,844 % fällig am 05.11.2031 (d)		1.400	1.407	0,42
Kennedy Wilson Europe Real Estate Ltd.				
3,250 % fällig am 12.11.2025	€	1.300	990	0,30
Summe Jersey, Kanalinseln			5.510	1,65
LUXEMBURG				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Aroundtown S.A.				
3,625 % fällig am 10.04.2031	£	400	247	0,07
Logicor Financing SARL				
2,750 % fällig am 15.01.2030		1.800	1.325	0,40
Prologis International Funding S.A.				
2,750 % fällig am 22.02.2032		900	702	0,21
Summe Luxemburg			2.274	0,68
NIEDERLANDE				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
ABN AMRO Bank NV				
5,125 % fällig am 22.02.2028		600	561	0,17
Cooperatieve Rabobank UA				
1,875 % fällig am 12.07.2028		800	671	0,20
4,375 % fällig am 29.06.2027 (d)(f)	€	800	601	0,18
4,625 % fällig am 23.05.2029	£	2.000	1.757	0,53
5,250 % fällig am 14.09.2027		950	883	0,26
E.ON International Finance BV				
4,750 % fällig am 31.01.2034		2.000	1.790	0,54
5,875 % fällig am 30.10.2037		1.100	1.060	0,32
6,125 % fällig am 06.07.2039		200	197	0,06
Enel Finance International NV				
2,875 % fällig am 11.04.2029	£	1.300	£ 1.080	0,32
5,000 % fällig am 15.06.2032	$	1.000	744	0,22
5,750 % fällig am 14.09.2040	£	1.400	1.321	0,39
Holcim Sterling Finance Netherlands BV				
2,250 % fällig am 04.04.2034		1.600	1.105	0,33
ING Groep NV				
1,125 % fällig am 07.12.2028		1.500	1.178	0,35
6,250 % fällig am 20.05.2033		700	649	0,19
JDE Peet's NV				
0,500 % fällig am 16.01.2029	€	600	424	0,13
Toyota Motor Finance Netherlands BV				
4,625 % fällig am 08.06.2026	£	700	669	0,20
Volkswagen Financial Services NV				
0,875 % fällig am 20.02.2025		400	364	0,11
1,125 % fällig am 18.09.2023		200	198	0,06
2,125 % fällig am 18.01.2028		2.700	2.224	0,66
			17.476	5,22
STAATSEMISSIONEN				
Nederlandse Waterschapsbank NV				
5,375 % fällig am 07.06.2032		1.000	1.039	0,31
Summe Niederlande			18.515	5,53
NORWEGEN				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
DNB Bank ASA				
2,625 % fällig am 10.06.2026		700	647	0,19
Equinor ASA				
4,250 % fällig am 10.04.2041		1.300	1.133	0,34
Summe Norwegen			1.780	0,53
SINGAPUR				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Temasek Financial Ltd.				
5,125 % fällig am 26.07.2040		770	753	0,22
SPANIEN				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Abertis Infraestructuras S.A.				
3,375 % fällig am 27.11.2026		200	178	0,05
Banco Santander S.A.				
1,500 % fällig am 14.04.2026		700	602	0,18
CaixaBank S.A.				
1,500 % fällig am 03.12.2026		500	432	0,13
3,500 % fällig am 06.04.2028		900	783	0,24
6,875 % fällig am 25.10.2033		300	280	0,08
Summe Spanien			2.275	0,68
SUPRANATIONAL				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Europäische Investitionsbank				
0,750 % fällig am 15.11.2024		1.700	1.589	0,47
3,750 % fällig am 07.12.2027		1.350	1.268	0,38
4,500 % fällig am 07.06.2029		1.000	972	0,29
5,625 % fällig am 07.06.2032		1.000	1.072	0,32
6,000 % fällig am 07.12.2028		800	831	0,25
Internationale Bank für Wiederaufbau und Entwicklung				
1,250 % fällig am 13.12.2028		1.100	899	0,27
5,750 % fällig am 07.06.2032		2.400	2.578	0,77
International Development Association				
0,750 % fällig am 21.09.2028		1.100	876	0,26
1,750 % fällig am 05.05.2037	€	500	363	0,11
International Finance Corp.				
0,750 % fällig am 22.07.2027	£	1.500	1.251	0,37
Summe Supranational			11.699	3,49
SCHWEDEN				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Investor AB				
5,500 % fällig am 05.05.2037		1.100	1.106	0,33
Swedbank AB				
5,875 % fällig am 24.05.2029		800	761	0,23
Volvo Treasury AB				
6,125 % fällig am 22.06.2028		300	298	0,09
Summe Schweden			2.165	0,65

BESCHREIBUNG		PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
SCHWEIZ				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Credit Suisse AG				
7,750 % fällig am 10.03.2026	£	1.400	£ 1.418	0,42
UBS AG				
5,125 % fällig am 15.05.2024 (f)	$	500	387	0,12
UBS Group AG				
0,250 % fällig am 29.01.2026	€	300	238	0,07
0,625 % fällig am 18.01.2033		100	60	0,02
4,125 % fällig am 24.09.2025	$	950	714	0,21
4,550 % fällig am 17.04.2026		300	227	0,07
7,375 % fällig am 07.09.2033	£	1.500	1.572	0,47
Summe Schweiz			4.616	1,38
GROSSBRITANNIEN				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
3i Group PLC				
3,750 % fällig am 05.06.2040		850	607	0,18
Anchor Hanover Group				
2,000 % fällig am 21.07.2051		400	210	0,06
Anglian Water Services Financing PLC				
2,750 % fällig am 26.10.2029		800	666	0,20
5,875 % fällig am 20.06.2031		1.000	990	0,30
Annington Funding PLC				
2,308 % fällig am 06.10.2032		2.000	1.393	0,42
3,184 % fällig am 12.07.2029		200	160	0,05
3,935 % fällig am 12.07.2047		900	619	0,18
Assura Financing PLC				
1,625 % fällig am 30.06.2033		1.000	656	0,20
Aviva PLC				
5,125 % fällig am 04.06.2050		200	174	0,05
6,875 % fällig am 20.05.2058		900	995	0,30
Barclays PLC				
1,700 % fällig am 03.11.2026		800	703	0,21
3,250 % fällig am 12.02.2027		200	175	0,05
3,250 % fällig am 17.01.2033		1.700	1.275	0,38
6,369 % fällig am 31.01.2031		1.800	1.725	0,52
8,407 % fällig am 14.11.2032		600	596	0,18
Berkeley Group PLC				
2,500 % fällig am 11.08.2031		1.200	785	0,23
Beyond Housing Ltd.				
2,125 % fällig am 17.05.2051		500	273	0,08
BG Energy Capital PLC				
5,000 % fällig am 04.11.2036		300	278	0,08
Blend Funding PLC				
3,459 % fällig am 21.09.2049		800	586	0,18
BP Capital Markets PLC				
5,773 % fällig am 25.05.2038		1.200	1.184	0,35
BPHA Finance PLC				
4,816 % fällig am 11.04.2044		300	271	0,08
British Land Co. PLC				
2,375 % fällig am 14.09.2029		2.100	1.604	0,48
British Telecommunications PLC				
3,125 % fällig am 21.11.2031		800	645	0,19
3,625 % fällig am 21.11.2047		400	273	0,08
5,750 % fällig am 13.02.2041		600	555	0,17
Cadent Finance PLC				
2,625 % fällig am 22.09.2038		950	613	0,18
2,750 % fällig am 22.09.2046		700	407	0,12
5,750 % fällig am 14.03.2034		500	481	0,14
Chanel Ceres PLC				
0,500 % fällig am 31.07.2026	€	600	459	0,14
Clarion Funding PLC				
1,875 % fällig am 22.01.2035	£	1.000	673	0,20
1,875 % fällig am 07.09.2051		1.400	662	0,20
3,125 % fällig am 19.04.2048		300	198	0,06
Compass Group PLC				
4,375 % fällig am 08.09.2032		1.100	1.011	0,30
Derwent London PLC				
1,875 % fällig am 17.11.2031		1.900	1.317	0,39
Diageo Finance PLC				
2,750 % fällig am 08.06.2038		600	438	0,13
EMH Treasury PLC				
4,500 % fällig am 29.01.2044		300	260	0,08
ENW Finance PLC				
1,415 % fällig am 30.07.2030		400	296	0,09
4,893 % fällig am 24.11.2032		1.700	1.567	0,47
GlaxoSmithKline Capital PLC				
1,625 % fällig am 12.05.2035	£	2.100	£ 1.418	0,42
Grainger PLC				
3,000 % fällig am 03.07.2030		1.385	1.050	0,31
Greene King Finance PLC				
3,593 % fällig am 15.03.2035		361	291	0,09
4,064 % fällig am 15.03.2035		202	166	0,05
5,106 % fällig am 15.03.2034		533	470	0,14
5,318 % fällig am 15.09.2031		1.367	1.231	0,37
Haleon UK Capital PLC				
2,875 % fällig am 29.10.2028		1.450	1.246	0,37
3,375 % fällig am 29.03.2038		1.100	834	0,25
HSBC Holdings PLC				
1,750 % fällig am 24.07.2027		1.000	853	0,25
3,000 % fällig am 22.07.2028		1.700	1.460	0,44
3,000 % fällig am 29.05.2030		1.700	1.381	0,41
5,875 % fällig am 28.09.2026 (d)(f)		900	787	0,24
6,000 % fällig am 29.03.2040		978	859	0,26
Hyde Housing Association Ltd.				
5,125 % fällig am 23.07.2040		1.000	952	0,28
InterContinental Hotels Group PLC				
2,125 % fällig am 24.08.2026		1.000	865	0,26
3,375 % fällig am 08.10.2028		400	340	0,10
John Lewis PLC				
4,250 % fällig am 18.12.2034		1.344	838	0,25
6,125 % fällig am 21.01.2025		600	578	0,17
Karbon Homes Ltd.				
3,375 % fällig am 15.11.2047		400	293	0,09
Land Securities Capital Markets PLC				
2,399 % fällig am 08.02.2031		1.251	1.043	0,31
4,875 % fällig am 15.09.2034		500	474	0,14
LCR Finance PLC				
4,500 % fällig am 07.12.2038		1.400	1.354	0,40
Legal & General Group PLC				
5,375 % fällig am 27.10.2045		1.200	1.139	0,34
5,625 % fällig am 24.03.2031 (d)(f)		850	657	0,20
Lloyds Banking Group PLC				
2,000 % fällig am 12.04.2028		2.600	2.160	0,65
8,500 % fällig am 27.09.2027 (d)(f)		300	282	0,08
London & Quadrant Housing Trust				
2,000 % fällig am 20.10.2038		1.250	772	0,23
M&G PLC				
5,625 % fällig am 20.10.2051		400	354	0,11
Manchester Airport Group Funding PLC				
2,875 % fällig am 31.03.2039		235	161	0,05
2,875 % fällig am 30.09.2044		900	572	0,17
4,750 % fällig am 31.03.2034		500	454	0,14
Marks & Spencer PLC				
3,750 % fällig am 19.05.2026		100	90	0,03
Metropolitan Housing Trust Ltd.				
1,875 % fällig am 28.07.2036		1.800	1.160	0,35
Mitchells & Butlers Finance PLC				
5,965 % fällig am 15.12.2025		40	39	0,01
6,002 % fällig am 15.12.2030	$	1.165	844	0,25
6,013 % fällig am 15.12.2030	£	418	376	0,11
Morhomes PLC				
3,400 % fällig am 19.02.2040		1.100	834	0,25
Motability Operations Group PLC				
2,125 % fällig am 18.01.2042		1.900	1.187	0,35
3,625 % fällig am 10.03.2036		1.250	1.040	0,31
4,875 % fällig am 17.01.2043		700	654	0,20
5,625 % fällig am 29.11.2030		100	101	0,03
National Gas Transmission PLC				
1,375 % fällig am 07.02.2031		800	569	0,17
National Grid Electricity Distribution East Midlands PLC				
1,750 % fällig am 09.09.2031		400	293	0,09
National Grid Electricity Distribution South Wales PLC				
5,750 % fällig am 23.03.2040		850	828	0,25
National Grid Electricity Distribution West Midlands PLC				
5,750 % fällig am 16.04.2032		1.600	1.564	0,47
National Grid Electricity Transmission PLC				
1,125 % fällig am 07.07.2028		1.400	1.098	0,33
2,750 % fällig am 06.02.2035		900	656	0,20
5,272 % fällig am 18.01.2043		1.100	1.009	0,30
Nationwide Building Society				
6,178 % fällig am 07.12.2027		1.200	1.163	0,35
NatWest Group PLC				
2,057 % fällig am 09.11.2028	£	1.800	£ 1.467	0,44
2,875 % fällig am 19.09.2026		500	454	0,14
3,125 % fällig am 28.03.2027		500	448	0,13
3,619 % fällig am 29.03.2029		900	774	0,23
5,125 % fällig am 12.05.2027 (d)(f)		1.100	909	0,27
7,416 % fällig am 06.06.2033		600	582	0,17
NatWest Markets PLC				
6,375 % fällig am 08.11.2027		1.300	1.278	0,38
Network Rail Infrastructure Finance PLC				
4,750 % fällig am 29.11.2035		1.800	1.786	0,53
NIE Finance PLC				
5,875 % fällig am 01.12.2032		1.100	1.088	0,32
Northern Gas Networks Finance PLC				
4,875 % fällig am 15.11.2035		250	221	0,07
5,625 % fällig am 23.03.2040		50	47	0,01
Northern Powergrid Yorkshire PLC				
4,375 % fällig am 05.07.2032		300	270	0,08
5,125 % fällig am 04.05.2035		200	188	0,06
Northumbrian Water Finance PLC				
4,500 % fällig am 14.02.2031		1.000	896	0,27
5,625 % fällig am 29.04.2033		883	846	0,25
Notting Hill Genesis				
2,000 % fällig am 03.06.2036		700	458	0,14
3,250 % fällig am 12.10.2048		1.000	667	0,20
3,750 % fällig am 20.12.2032		300	256	0,08
Pacific Quay Finance PLC				
5,565 % fällig am 25.07.2034		154	149	0,04
Paragon Treasury PLC				
2,000 % fällig am 07.05.2036		500	324	0,10
Peabody Capital PLC				
3,250 % fällig am 14.09.2048		900	606	0,18
Places for People Homes Ltd.				
3,625 % fällig am 22.11.2028		900	786	0,23
5,875 % fällig am 23.05.2031		568	559	0,17
Places for People Treasury PLC				
2,500 % fällig am 26.01.2036		800	548	0,16
Platform HG Financing PLC				
1,926 % fällig am 15.09.2041		1.100	674	0,20
Prudential Funding Asia PLC				
6,125 % fällig am 19.12.2031		580	561	0,17
Quadgas Finance PLC				
3,375 % fällig am 17.09.2029		800	636	0,19
RHP Finance PLC				
3,250 % fällig am 05.02.2048		350	251	0,07
Riverside Finance PLC				
3,875 % fällig am 05.12.2044		900	708	0,21
Sage Group PLC				
1,625 % fällig am 25.02.2031		800	588	0,18
2,875 % fällig am 08.02.2034		1.500	1.131	0,34
Santander UK Group Holdings PLC				
2,421 % fällig am 17.01.2029		1.400	1.139	0,34
3,625 % fällig am 14.01.2026		600	549	0,16
7,098 % fällig am 16.11.2027		500	491	0,15
Scotland Gas Networks PLC				
4,875 % fällig am 21.12.2034		300	267	0,08
Scottish Hydro Electric Transmission PLC				
2,125 % fällig am 24.03.2036		1.050	703	0,21
2,250 % fällig am 27.09.2035		2.350	1.626	0,49
Segro PLC				
5,750 % fällig am 20.06.2035		300	294	0,09
Severn Trent Utilities Finance PLC				
2,000 % fällig am 02.06.2040		600	350	0,10
2,625 % fällig am 22.02.2033		1.000	757	0,23
4,625 % fällig am 30.11.2034		400	356	0,11
4,875 % fällig am 24.01.2042		800	701	0,21
5,250 % fällig am 04.04.2036		300	280	0,08
Sky Ltd.				
4,000 % fällig am 26.11.2029		500	454	0,14
Society of Lloyd's				
4,875 % fällig am 07.02.2047		500	451	0,13
South Eastern Power Networks PLC				
1,750 % fällig am 30.09.2034		3.800	2.563	0,77
Southern Electric Power Distribution PLC				
5,500 % fällig am 07.06.2032		800	785	0,23
Southern Gas Networks PLC				
3,100 % fällig am 15.09.2036		1.600	1.154	0,34

BESCHREIBUNG		PAR (000S)		MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
Southern Housing					
2,375 % fällig am 08.10.2036	£	1.900	£	1.304	0,39
Sovereign Housing Capital PLC					
2,375 % fällig am 04.11.2048		1.000		583	0,17
Telereal Securitisation PLC					
4,974 % fällig am 10.12.2033		141		136	0,04
Tesco Corporate Treasury Services PLC					
1,875 % fällig am 02.11.2028		1.000		800	0,24
5,500 % fällig am 27.02.2035		300		277	0,08
Tesco Property Finance PLC					
5,661 % fällig am 13.10.2041		276		253	0,08
5,744 % fällig am 13.04.2040		1.335		1.239	0,37
5,801 % fällig am 13.10.2040		277		259	0,08
6,052 % fällig am 13.10.2039		113		108	0,03
Thames Water Utilities Finance PLC					
2,375 % fällig am 22.04.2040		800		459	0,14
2,625 % fällig am 24.01.2032		1.300		959	0,29
3,500 % fällig am 25.02.2028		1.300		1.108	0,33
4,375 % fällig am 18.01.2031	€	600		459	0,14
Together Housing Finance PLC					
4,500 % fällig am 17.12.2042	£	400		341	0,10
TP ICAP Finance PLC					
2,625 % fällig am 18.11.2028		1.650		1.220	0,36
Travis Perkins PLC					
3,750 % fällig am 17.02.2026		300		270	0,08
Unique Pub Finance Co. PLC					
5,659 % fällig am 30.06.2027		908		890	0,27
7,395 % fällig am 28.03.2024		179		180	0,05
UNITE Group PLC					
3,500 % fällig am 15.10.2028		1.000		844	0,25
Virgin Media Secured Finance PLC					
4,250 % fällig am 15.01.2030		400		316	0,09
Virgin Money UK PLC					
3,375 % fällig am 24.04.2026		250		228	0,07
4,000 % fällig am 25.09.2026		1.600		1.447	0,43
Vodafone Group PLC					
3,375 % fällig am 08.08.2049		1.900		1.208	0,36
Weir Group PLC					
6,875 % fällig am 14.06.2028		1.800		1.776	0,53
Wellcome Trust Ltd.					
1,500 % fällig am 14.07.2071		1.300		515	0,15
Workspace Group PLC					
2,250 % fällig am 11.03.2028		1.000		733	0,22
Yorkshire Building Society					
1,500 % fällig am 15.09.2029		800		603	0,18
Yorkshire Water Finance PLC					
1,750 % fällig am 27.10.2032		949		662	0,20
2,750 % fällig am 18.04.2041		700		449	0,13
3,625 % fällig am 01.08.2029		500		435	0,13
5,250 % fällig am 28.04.2030		900		849	0,25
5,500 % fällig am 28.04.2035		500		469	0,14
				119.074	35,56
NON-AGENCY-MBS					
Alba PLC					
5,171 % fällig am 15.12.2038		827		791	0,24
Atlas Funding PLC					
5,432 % fällig am 25.07.2058		934		933	0,28
5,937 % fällig am 20.01.2061		594		595	0,18
Avon Finance PLC					
5,809 % fällig am 20.09.2048		1.437		1.437	0,43
Barley Hill PLC					
5,824 % fällig am 27.08.2058		710		706	0,21
Brants Bridge PLC					
6,115 % fällig am 12.12.2064		250		251	0,07
Canada Square Funding PLC					
5,852 % fällig am 17.06.2058		63		63	0,02
Eurohome UK Mortgages PLC					
5,137 % fällig am 15.06.2044		77		74	0,02
EuroMASTR PLC					
5,205 % fällig am 15.06.2040		525		484	0,14
Gosforth Funding PLC					
5,465 % fällig am 25.08.2060		177		177	0,05
Great Hall Mortgages PLC					
5,152 % fällig am 18.03.2039		334		331	0,10
5,172 % fällig am 18.06.2038		6		6	0,00

BESCHREIBUNG		PAR (000S)		MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
Harbour					
5,457 % fällig am 28.01.2054	£	300	£	296	0,09
Hops Hill PLC					
5,854 % fällig am 27.05.2054		630		630	0,19
Lanark Master Issuer PLC					
5,319 % fällig am 22.12.2069		200		200	0,06
London Wall Mortgage Capital PLC					
5,452 % fällig am 15.05.2051		335		333	0,10
Ludgate Funding PLC					
5,030 % fällig am 01.01.2061		1.618		1.549	0,46
Mansard Mortgages PLC					
5,651 % fällig am 15.12.2049		78		77	0,02
Mortimer BTL PLC					
5,614 % fällig am 23.06.2053		1.548		1.531	0,46
5,976 % fällig am 23.03.2054		872		872	0,26
Newgate Funding PLC					
4,126 % fällig am 15.12.2050	€	790		654	0,20
Pierpont BTL PLC					
0,000 % fällig am 21.09.2054	£	1.000		998	0,30
Polaris PLC					
5,631 % fällig am 23.12.2058		935		930	0,28
6,141 % fällig am 23.05.2059		1.159		1.161	0,35
Residential Mortgage Securities PLC					
6,159 % fällig am 20.06.2070		1.069		1.072	0,32
Stratton Mortgage Funding PLC					
5,391 % fällig am 20.07.2060		1.237		1.237	0,37
5,765 % fällig am 12.03.2052		63		63	0,02
5,792 % fällig am 25.09.2051		68		68	0,02
Towd Point Mortgage Funding PLC					
5,635 % fällig am 20.10.2051		1.287		1.289	0,38
5,841 % fällig am 20.07.2045		235		235	0,07
Twin Bridges PLC					
5,715 % fällig am 12.03.2055		1.264		1.259	0,38
				20.302	6,07
STAATSEMISSIONEN					
United Kingdom Gilt					
0,125 % fällig am 30.01.2026		14.100		12.433	3,71
1,250 % fällig am 31.07.2051		3.400		1.687	0,50
1,500 % fällig am 31.07.2053		12.600		6.580	1,96
1,625 % fällig am 22.10.2028 (g)		17.700		15.200	4,54
3,500 % fällig am 22.10.2025 (g)		14.900		14.227	4,25
3,750 % fällig am 22.07.2052		1.800		1.606	0,48
3,750 % fällig am 22.10.2053		3.300		2.935	0,88
4,250 % fällig am 07.03.2036		10.500		10.308	3,08
4,250 % fällig am 07.12.2049		300		290	0,09
				65.266	19,49
Summe Großbritannien				204.642	61,12
USA					
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL					
AES Corp.					
2,450 % fällig am 15.01.2031	$	900		573	0,17
Amgen, Inc.					
4,000 % fällig am 13.09.2029	£	740		667	0,20
5,250 % fällig am 02.03.2033	$	200		158	0,05
Apple, Inc.					
3,050 % fällig am 31.07.2029	£	500		442	0,13
3,600 % fällig am 31.07.2042		600		499	0,15
AT&T, Inc.					
4,250 % fällig am 01.06.2043		1.800		1.378	0,41
4,375 % fällig am 14.09.2029		1.000		902	0,27
4,875 % fällig am 01.06.2044		500		415	0,12
Bank of America Corp.					
3,584 % fällig am 27.04.2031		2.800		2.373	0,71
Berkshire Hathaway Finance Corp.					
2,375 % fällig am 19.06.2039		1.600		1.088	0,32
Citigroup, Inc.					
1,750 % fällig am 23.10.2026		1.000		862	0,26
2,750 % fällig am 24.01.2024		650		638	0,19
5,150 % fällig am 21.05.2026		1.060		1.026	0,31
Comcast Corp.					
1,500 % fällig am 20.02.2029		400		319	0,10
1,875 % fällig am 20.02.2036		1.200		804	0,24
Credit Suisse AG AT1 Claim ^	$	200		6	0,00

BESCHREIBUNG		PAR (000S)		MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
Digital Stout Holding LLC					
3,300 % fällig am 19.07.2029	£	816	£	660	0,20
3,750 % fällig am 17.10.2030		1.350		1.103	0,33
Eli Lilly & Co.					
1,625 % fällig am 14.09.2043		800		455	0,14
Fiserv, Inc.					
3,000 % fällig am 01.07.2031		791		634	0,19
Ford Motor Co.					
3,250 % fällig am 12.02.2032	$	150		93	0,03
Ford Motor Credit Co. LLC					
7,200 % fällig am 10.06.2030		1.000		795	0,24
General Motors Financial Co., Inc.					
5,150 % fällig am 15.08.2026	£	500		474	0,14
Goldman Sachs Group, Inc.					
1,875 % fällig am 16.12.2030		3.200		2.376	0,71
3,625 % fällig am 29.10.2029		2.350		2.030	0,61
International Business Machines Corp.					
4,875 % fällig am 06.02.2038		400		357	0,11
JPMorgan Chase & Co.					
1,895 % fällig am 28.04.2033		1.500		1.089	0,33
MassMutual Global Funding					
1,375 % fällig am 15.12.2026		1.500		1.270	0,38
McDonald's Corp.					
2,950 % fällig am 15.03.2034		500		393	0,12
3,750 % fällig am 31.05.2038		500		400	0,12
Metropolitan Life Global Funding					
0,625 % fällig am 08.12.2027		400		314	0,09
1,625 % fällig am 21.09.2029		400		308	0,09
3,500 % fällig am 30.09.2026		740		677	0,20
5,000 % fällig am 10.01.2030		900		854	0,25
Morgan Stanley					
5,789 % fällig am 18.11.2033		900		864	0,26
Nestle Holdings, Inc.					
2,500 % fällig am 04.04.2032		1.500		1.221	0,36
New York Life Global Funding					
1,250 % fällig am 17.12.2026		500		422	0,13
4,350 % fällig am 16.09.2025		1.600		1.528	0,46
Pfizer, Inc.					
2,735 % fällig am 15.06.2043		1.000		683	0,20
Realty Income Corp.					
1,750 % fällig am 13.07.2033		1.100		736	0,22
Time Warner Cable LLC					
5,250 % fällig am 15.07.2042		1.100		872	0,26
Verizon Communications, Inc.					
1,875 % fällig am 19.09.2030		500		382	0,11
1,875 % fällig am 03.11.2038		700		416	0,12
2,500 % fällig am 08.04.2031		1.400		1.106	0,33
3,125 % fällig am 02.11.2035		200		150	0,04
3,375 % fällig am 27.10.2036		1.200		914	0,27
4,750 % fällig am 17.02.2034		550		498	0,15
Walmart, Inc.					
5,625 % fällig am 27.03.2034		300		310	0,09
Wells Fargo & Co.					
2,125 % fällig am 24.09.2031		1.800		1.333	0,40
2,500 % fällig am 02.05.2029		2.050		1.641	0,49
3,500 % fällig am 12.09.2029		700		589	0,18
Welltower OP LLC					
4,800 % fällig am 20.11.2028		500		451	0,13
				40.548	12,11
NON-AGENCY-MBS					
Deutsche ALT-A Securities, Inc. Mortgage Loan Trust					
5,650 % fällig am 25.04.2035	$	90		63	0,02
Sequoia Mortgage Trust					
3,565 % fällig am 20.07.2037 ^		5		3	0,00
Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust					
5,282 % fällig am 25.02.2034		1		1	0,00
WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust					
5,176 % fällig am 25.11.2042		10		7	0,00
				74	0,02
US-REGIERUNGSBEHÖRDEN					
Fannie Mae					
4,560 % fällig am 01.08.2036		4		3	0,00
4,944 % fällig am 01.07.2044		4		3	0,00

BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
Uniform Mortgage-Backed Security, TBA			
4,500 % fällig am 01.07.2053	$ 1.180	£ 892	0,27
5,000 % fällig am 01.07.2053	1.180	909	0,27
5,500 % fällig am 01.08.2053	1.180	924	0,28
6,000 % fällig am 01.08.2053	1.180	936	0,28
6,500 % fällig am 01.07.2053	1.180	948	0,28
		4.615	1,38
Summe USA		45.237	13,51

BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
KURZFRISTIGE INSTRUMENTE			
U.K. TREASURY BILLS			
4,480 % fällig am 03.07.2023 (b)(c)	£ 5.400	£ 5.400	1,61
4,510 % fällig am 03.07.2023 (b)(c)	2.900	2.900	0,87
4,700 % fällig am 17.07.2023 (b)(c)	5.400	5.390	1,61
Summe kurzfristige Instrumente		13.690	4,09
Summe Übertragbare Wertpapiere		**£ 345.995**	**103,33**

BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
INVESTMENTFONDS			
BÖRSENGEHANDELTE FONDS			
PIMCO ETFs plc - PIMCO Euro Short Maturity UCITS ETF (e)	2.500	£ 208	0,06
Summe Investmentfonds		**£ 208**	**0,06**

PENSIONSGESCHÄFTE

Kontrahent	Kredit-zins	Abrechnungs-datum	Fälligkeits-datum	Kapital-betrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensions-geschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensions-geschäft[1]	% des Nettovermögens
BRC	4,940 %	30.06.2023	03.07.2023	£ 13.000	United Kingdom Gilt 0,625 % fällig am 31.07.2035	£ (13.263)	£ 13.000	£ 13.005	3,88
FICC	2,400	30.06.2023	03.07.2023	$ 130	U.S. Treasury Notes 4,625 % fällig am 30.06.2025	(104)	102	102	0,03
Summe Pensionsgeschäfte						**£ (13.367)**	**£ 13.102**	**£ 13.107**	**3,91**

[1] Umfasst aufgelaufene Zinsen.

AN EINEM GEREGELTEN MARKT GEHANDELTE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*, außer Anzahl der Kontrakte)

*** Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt**

FUTURES

Beschreibung	Art	Ablauf-monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Euro-Bobl September Futures	Short	09.2023	21	£ 27	0,01
Euro-Bund 10-Year Bond September Futures	Short	09.2023	30	33	0,01
Euro-Schatz September Futures	Long	09.2023	26	(20)	(0,01)
Japan Government 10-Year Bond September Futures	Short	09.2023	5	(14)	0,00
U.S. Treasury 5-Year Note September Futures	Long	09.2023	35	(23)	(0,01)
U.S. Treasury 10-Year Note September Futures	Long	09.2023	123	(183)	(0,05)
U.S. Treasury 10-Year Ultra September Futures	Short	09.2023	2	1	0,00
U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond September Futures	Short	09.2023	33	(51)	(0,02)
United Kingdom Long Gilt September Futures	Short	09.2023	194	88	0,03
				£ (142)	(0,04)
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate				**£ (142)**	**(0,04)**

ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)

*** Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt**

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMMISSIONEN - SCHUTZVERKAUF[1]

Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag[2]	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Marks & Spencer PLC	1,000 %	20.06.2030	€ 500	£ 3	0,00

ZINSSWAPS

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fest-Zinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Zahlung	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	0,500 %	21.09.2024	£ 44.600	£ (904)	(0,27)
Zahlung	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	2,728	16.12.2025	20.400	(737)	(0,22)
Erhalt[3]	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	3,250	20.09.2053	5.300	228	0,07
Erhalt[3]	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	3,500	20.09.2033	4.000	92	0,03
Erhalt[3]	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	3,750	20.09.2028	800	6	0,00
Zahlung[3]	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	4,000	20.09.2025	6.800	(210)	(0,06)
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,000	15.12.2026	$ 3.100	(307)	(0,09)
Erhalt[3]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,250	17.06.2030	9.200	1.262	0,38
Erhalt[3]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,500	18.12.2029	9.300	856	0,25
Zahlung[3]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,000	12.02.2045	2.100	(409)	(0,12)
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,250	17.09.2023	9.200	78	0,02
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,500	18.09.2023	9.300	74	0,02
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	2,000	12.08.2023	2.100	(7)	0,00

Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fest-Zinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,547 %	09.03.2033	€ 1.600	£ (26)	(0,01)
Erhalt[3]	6-Month EUR-EURIBOR	3,000	20.09.2028	400	(1)	0,00
Zahlung[3]	6-Month EUR-EURIBOR	3,000	20.09.2033	1.900	18	0,01
Erhalt[3]	6-Month EUR-EURIBOR	3,500	20.09.2025	5.400	(4)	0,00
					£ 9	0,01
Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate					**£ 12**	**0,01**

(1) Agiert der Fonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Fonds entweder (i) dem Sicherungsnehmer einen Betrag, der dem Nennwert des Swaps entspricht, und erhält die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er zahlt einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.

(2) Der maximal mögliche Betrag, den der Fonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

(3) Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft.

DERIVATIVE OTC-FINANZINSTRUMENTE (Beträge in Tausend*, außer Anzahl der Kontrakte)

*** Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt**

DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BRC	08.2023	€ 759	£ 655	£ 3	£ (1)	£ 2	0,00
	08.2023	£ 528	€ 606	0	(7)	(7)	0,00
	08.2023	$ 336	£ 268	4	0	4	0,00
CBK	08.2023	1.059	832	0	(1)	(1)	0,00
DUB	08.2023	£ 700	$ 870	0	(16)	(16)	(0,01)
JPM	08.2023	€ 6.241	£ 5.437	72	0	72	0,02
	08.2023	£ 1.695	€ 1.964	0	(6)	(6)	0,00
	08.2023	$ 3.744	£ 2.956	12	0	12	0,00
MBC	08.2023	£ 1.304	€ 1.505	0	(10)	(10)	0,00
	08.2023	461	$ 587	1	0	1	0,00
	08.2023	¥ 12.500	£ 74	6	0	6	0,00
MYI	08.2023	£ 366	$ 458	0	(6)	(6)	0,00
RBC	08.2023	€ 63	£ 55	0	0	0	0,00
	08.2023	£ 1.245	€ 1.427	0	(18)	(18)	(0,01)
	08.2023	1.105	$ 1.374	0	(23)	(23)	(0,01)
	08.2023	$ 722	£ 571	4	0	4	0,00
SCX	08.2023	€ 9.873	8.621	131	0	131	0,04
	08.2023	£ 884	€ 1.028	0	0	0	0,00
	08.2023	1.028	$ 1.291	0	(13)	(13)	0,00
	08.2023	$ 1.212	£ 946	0	(7)	(7)	0,00
UAG	08.2023	4.198	3.322	20	0	20	0,01
				£ 253	£ (108)	£ 145	0,04

Summe Freiverkehrsfinanzderivate	**£ 145**	**0,04**
Summe Anlagen	**£ 359.320**	**107,31**
Sonstige Aktiva und Passiva	**£ (24.485)**	**(7,31)**
Nettovermögen	**£ 334.835**	**100,00**

ERLÄUTERUNGEN ZUR AUFSTELLUNG DES WERTPAPIERBESTANDS (Angaben in Tausend*):

***** **Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt**

^ **Das Wertpapier ist in Verzug.**

(a) **Wertpapier per Emissionstermin.**

(b) **Nullkuponwertpapier.**

(c) **Der Kupon stellt eine Rendite bis zur Endfälligkeit dar.**

(d) **Unbegrenzte Laufzeit; das gegebenenfalls angegebene Datum stellt den nächsten vertraglichen Kündigungstermin dar.**

(e) **Mit dem Fonds verbunden.**

(f) **Bedingt wandelbares Wertpapier.**

(g) **Wertpapiere mit einem gesamten beizulegenden Zeitwert von 24.771 GBP (31. Dezember 2022: null GBP) wurden zum 30. Juni 2023 gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte als Sicherheit verpfändet.**

Barmittel in Höhe von 3.217 GBP (31. Dezember 2022: 7.199 GBP) wurden zum 30. Juni 2023 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Beizulegender Zeitwert[1]

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 30. Juni 2023 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie[2]	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	£ 0	£ 345.995	£ 0	£ 345.995
Investmentfonds	208	0	0	208
Pensionsgeschäfte	0	13.102	0	13.102
Finanzderivate[3]	114	(99)	0	15
Summen	**£ 322**	**£ 358.998**	**£ 0**	**£ 359.320**

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 31. Dezember 2022 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie[2]	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	£ 0	£ 372.745	£ 0	£ 372.745
Investmentfonds	0	5.370	0	5.370
Pensionsgeschäfte	0	177	0	177
Finanzderivate[3]	637	1.806	0	2.443
Summen	**£ 637**	**£ 380.098**	**£ 0**	**£ 380.735**

(1) Weitere Informationen finden Sie in den Erläuterungen in Erläuterung 3.

(2) Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung des Wertpapierbestands.

(3) Finanzderivate können offene Terminkontrakte, Swap-, Verkaufs- oder Kaufoptionen sowie Devisenterminkontrakte enthalten.

Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2023:

Kontrahent	Kredit-zins	Abrechnungs-datum	Fälligkeits-datum	Kredit-betrag	Verbindlichkeiten aus umgekehrten Pensions-geschäften	% des Nettovermögens
SCX	4,340 %	16.05.2023	08.08.2023	£ (15.930)	£ (16.017)	(4,78)
	4,650	16.05.2023	08.08.2023	(8.984)	(9.037)	(2,70)
Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte					**£ (25.054)**	**(7,48)**

Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC-Finanzderivate und -Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2023 und 31. Dezember 2022:

	Zum 30. Jun. 2023			Zum 31. Dez. 2022		
Kontrahent	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-engagement[1]	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-engagement[1]
BOA	£ k. A.	£ k. A.	£ k. A.	£ 260	£ (330)	£ (70)
BRC	(1)	0	(1)	k. A.	k. A.	k. A.
CBK	(1)	0	(1)	k. A.	k. A.	k. A.
DUB	(16)	0	(16)	k. A.	k. A.	k. A.
GLM	k. A.	k. A.	k. A.	(87)	0	(87)
JPM	78	0	78	k. A.	k. A.	k. A.
MBC	(3)	0	(3)	(9)	0	(9)
MYI	(6)	0	(6)	(8)	0	(8)
RBC	(37)	0	(37)	k. A.	k. A.	k. A.
SCX	111	0	111	k. A.	k. A.	k. A.
SSB	k. A.	k. A.	k. A.	(213)	0	(213)
UAG	20	0	20	k. A.	k. A.	k. A.

(1) Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären.

Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung des Wertpapierbestands zum 30. Juni 2023:

	30. Jun. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	99,95	94,43
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	3,38	1,35
Investmentfonds	0,06	1,38
Pensionsgeschäfte	3,91	0,05
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	(0,04)	0,16
Zentral abgerechnete Finanzderivate	0,01	0,48
Freiverkehrsfinanzderivate	0,04	(0,02)
Umgekehrte Pensionsgeschäfte	(7,48)	k. A.

Das Anlageportfolio des Fonds konzentriert sich zum 30. Juni 2023 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	30. Jun. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
Australien	0,12	k. A.
Österreich	k. A.	0,05
Belgien	0,08	0,07
Kanada	1,21	0,20
Cayman-Inseln	0,13	0,12
Tschechische Republik	0,02	k. A.
Dänemark	0,90	0,82
Frankreich	4,28	3,51
Deutschland	1,31	2,21
Irland	1,51	1,24
Italien	0,24	0,57
Japan	k. A.	0,31
Jersey, Kanalinseln	1,65	1,71
Luxemburg	0,68	1,18
Niederlande	5,53	5,67
Norwegen	0,53	0,42
Singapur	0,22	0,20
Spanien	0,68	1,11
Supranational	3,49	3,11
Schweden	0,65	0,44
Schweiz	1,38	0,89
Großbritannien	61,12	59,89
USA	13,51	11,68
Kurzfristige Instrumente	4,09	0,38
Investmentfonds	0,06	1,38
Pensionsgeschäfte	3,91	0,05
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	(0,04)	0,16
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	0,00	(0,01)
Credit Default Swaps auf Kreditindizes— Schutzverkauf	k. A.	0,10
Zinsswaps	0,01	0,39
Freiverkehrsfinanzderivate		
Verkaufsoptionen		
Credit Default Swaptions auf Kreditindizes	k. A.	0,00
Zinsswapoptionen	k. A.	(0,03)
Devisenterminkontrakte	0,04	0,01
Sonstige Aktiva und Passiva	(7,31)	2,17
Nettovermögen	100,00	100,00

BESCHREIBUNG		PAR (000S)		MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE					
AUSTRALIEN					
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL					
BHP Billiton Finance Ltd.					
4,300 % fällig am 25.09.2042	£	500	£	420	0,14
CAYMAN INSELN					
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL					
Southern Water Services Finance Ltd.					
3,000 % fällig am 28.05.2037		1.700		1.153	0,39
4,500 % fällig am 31.03.2052		700		573	0,19
Summe Cayman Inseln				1.726	0,58
DÄNEMARK					
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL					
Orsted A/S					
2,500 % fällig am 16.05.2033		850		638	0,21
5,125 % fällig am 13.09.2034		1.200		1.121	0,38
5,375 % fällig am 13.09.2042		2.100		1.973	0,66
Summe Dänemark				3.732	1,25
FRANKREICH					
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL					
AXA S.A.					
5,453 % fällig am 04.03.2026 (a)		600		584	0,19
BNP Paribas S.A.					
2,000 % fällig am 13.09.2036		1.600		1.004	0,34
4,625 % fällig am 12.01.2027 (a)(b)	$	400		249	0,08
5,750 % fällig am 13.06.2032	£	400		380	0,13
Electricite de France S.A.					
5,125 % fällig am 22.09.2050		4.800		3.851	1,29
5,500 % fällig am 27.03.2037		3.600		3.157	1,06
5,500 % fällig am 17.10.2041		4.800		4.137	1,39
5,625 % fällig am 25.01.2053		1.900		1.628	0,55
Engie S.A.					
5,000 % fällig am 01.10.2060		700		617	0,21
Orange S.A.					
5,625 % fällig am 23.01.2034		1.575		1.577	0,53
Societe Generale S.A.					
6,250 % fällig am 22.06.2033		500		497	0,17
				17.681	5,94
STAATSEMISSIONEN					
SNCF Reseau					
5,000 % fällig am 11.03.2052		400		389	0,13
5,250 % fällig am 31.01.2035		300		303	0,10
				692	0,23
Summe Frankreich				18.373	6,17
DEUTSCHLAND					
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL					
Deutsche Telekom AG					
3,125 % fällig am 06.02.2034		1.700		1.372	0,46
IRLAND					
FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE					
Toro European CLO DAC					
3,995 % fällig am 12.01.2032	€	2.600		2.188	0,73
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL					
ESB Finance DAC					
1,875 % fällig am 21.07.2035	£	300		202	0,07
GE Capital UK Funding Unlimited Co.					
5,875 % fällig am 18.01.2033		2.500		2.421	0,81
Zurich Finance Ireland Designated Activity Co.					
5,125 % fällig am 23.11.2052		1.200		1.040	0,35
				3.663	1,23
Summe Irland				5.851	1,96
ITALIEN					
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL					
Enel SpA					
5,750 % fällig am 22.06.2037		2.000		1.908	0,64
Intesa Sanpaolo SpA					
7,778 % fällig am 20.06.2054	$	1.000	£	784	0,26
Summe Italien				2.692	0,90
JERSEY, KANALINSELN					
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL					
AA Bond Co. Ltd.					
3,250 % fällig am 31.07.2050	£	200		152	0,05
5,500 % fällig am 31.07.2050		180		157	0,05
CPUK Finance Ltd.					
6,136 % fällig am 28.02.2047		700		662	0,22
Gatwick Funding Ltd.					
2,625 % fällig am 07.10.2048		1.400		802	0,27
2,875 % fällig am 05.07.2051		1.800		1.051	0,35
3,125 % fällig am 28.09.2041		1.000		677	0,23
3,250 % fällig am 26.02.2048		900		573	0,19
5,750 % fällig am 23.01.2039		129		121	0,04
Heathrow Funding Ltd.					
2,750 % fällig am 09.08.2051		2.000		1.167	0,39
4,625 % fällig am 31.10.2046		2.377		1.932	0,65
5,875 % fällig am 13.05.2043		300		290	0,10
HSBC Bank Capital Funding Sterling LP					
5,844 % fällig am 05.11.2031 (a)		2.321		2.333	0,79
Summe Jersey, Kanalinseln				9.917	3,33
LUXEMBURG					
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL					
Aroundtown S.A.					
3,000 % fällig am 16.10.2029		300		190	0,06
Becton Dickinson Euro Finance SARL					
1,336 % fällig am 13.08.2041	€	900		494	0,17
Prologis International Funding S.A.					
3,000 % fällig am 22.02.2042	£	1.000		669	0,23
Summe Luxemburg				1.353	0,46
MEXIKO					
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL					
America Movil S.A.B. de C.V.					
4,375 % fällig am 07.08.2041		388		322	0,11
4,948 % fällig am 22.07.2033		100		93	0,03
Summe Mexiko				415	0,14
NIEDERLANDE					
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL					
Cooperatieve Rabobank UA					
5,250 % fällig am 23.05.2041		2.050		2.071	0,69
CTP NV					
1,250 % fällig am 21.06.2029	€	400		249	0,08
E.ON International Finance BV					
4,750 % fällig am 31.01.2034	£	3.800		3.402	1,14
5,875 % fällig am 30.10.2037		2.500		2.410	0,81
6,125 % fällig am 06.07.2039		1.650		1.628	0,55
Enel Finance International NV					
5,750 % fällig am 14.09.2040		2.763		2.606	0,87
Holcim Sterling Finance Netherlands BV					
2,250 % fällig am 04.04.2034		1.800		1.243	0,42
3,000 % fällig am 12.05.2032		300		234	0,08
ING Groep NV					
6,250 % fällig am 20.05.2033		600		557	0,19
JAB Holdings BV					
2,250 % fällig am 19.12.2039	€	400		244	0,08
Siemens Financieringsmaatschappij NV					
3,750 % fällig am 10.09.2042	£	2.200		1.841	0,62
Summe Niederlande				16.485	5,53
NORWEGEN					
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL					
Equinor ASA					
4,250 % fällig am 10.04.2041		700		610	0,21
SINGAPUR					
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL					
Temasek Financial Ltd.					
5,125 % fällig am 26.07.2040		1.050		1.027	0,35
SUPRANATIONAL					
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL					
Europäische Investitionsbank					
3,875 % fällig am 08.06.2037	£	1.200	£	1.104	0,37
SCHWEDEN					
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL					
Investor AB					
5,500 % fällig am 05.05.2037		1.300		1.307	0,44
GROSSBRITANNIEN					
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL					
3i Group PLC					
3,750 % fällig am 05.06.2040		1.400		999	0,34
Accent Capital PLC					
2,625 % fällig am 18.07.2049		400		248	0,08
Anglian Water Services Financing PLC					
6,000 % fällig am 20.06.2039		400		400	0,13
Annington Funding PLC					
2,308 % fällig am 06.10.2032		1.600		1.114	0,37
2,924 % fällig am 06.10.2051		2.500		1.364	0,46
3,685 % fällig am 12.07.2034		1.319		994	0,33
Aviva PLC					
4,000 % fällig am 03.06.2055		1.600		1.199	0,40
Barclays PLC					
3,250 % fällig am 17.01.2033		1.530		1.147	0,39
8,875 % fällig am 15.09.2027 (a)(b)		500		461	0,15
9,250 % fällig am 15.09.2028 (a)(b)		900		815	0,27
Berkeley Group PLC					
2,500 % fällig am 11.08.2031		800		523	0,18
BG Energy Capital PLC					
5,000 % fällig am 04.11.2036		300		278	0,09
Blend Funding PLC					
3,459 % fällig am 21.09.2049		300		220	0,07
BP Capital Markets PLC					
5,773 % fällig am 25.05.2038		100		99	0,03
BPHA Finance PLC					
4,816 % fällig am 11.04.2044		495		447	0,15
British Land Co. PLC					
2,375 % fällig am 14.09.2029		800		611	0,21
5,264 % fällig am 24.09.2035		400		363	0,12
British Telecommunications PLC					
3,125 % fällig am 21.11.2031		400		323	0,11
3,625 % fällig am 21.11.2047		300		205	0,07
5,750 % fällig am 13.02.2041		2.500		2.312	0,78
8,375 % fällig am 20.12.2083		800		788	0,26
Broadgate Financing PLC					
4,999 % fällig am 05.10.2033		600		553	0,19
5,098 % fällig am 05.04.2035		88		77	0,03
Cadent Finance PLC					
2,250 % fällig am 10.10.2035		500		332	0,11
2,625 % fällig am 22.09.2038		2.700		1.742	0,58
2,750 % fällig am 22.09.2046		1.500		873	0,29
3,125 % fällig am 21.03.2040		300		204	0,07
Catalyst Housing Ltd.					
3,125 % fällig am 31.10.2047		900		596	0,20
Chancellor Masters & Scholars of the University of Cambridge					
2,350 % fällig am 27.06.2078		200		115	0,04
3,750 % fällig am 17.10.2052		800		667	0,22
Church Commissioners for England					
3,625 % fällig am 14.07.2052		1.400		1.056	0,35
Citizen Treasury PLC					
3,250 % fällig am 20.10.2048		1.300		910	0,31
Clarion Funding PLC					
1,250 % fällig am 13.11.2032		100		68	0,02
1,875 % fällig am 22.01.2035		3.600		2.424	0,81
1,875 % fällig am 07.09.2051		2.600		1.230	0,41
3,125 % fällig am 19.04.2048		1.000		659	0,22
Derwent London PLC					
1,875 % fällig am 17.11.2031		1.750		1.213	0,41
Diageo Finance PLC					
2,750 % fällig am 08.06.2038		2.200		1.605	0,54
Eastern Power Networks PLC					
2,125 % fällig am 25.11.2033		721		519	0,17

BESCHREIBUNG		PAR (000S)		MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
EMH Treasury PLC					
4,500 % fällig am 29.01.2044	£	800	£	692	0,23
Eversholt Funding PLC					
3,529 % fällig am 07.08.2042		800		574	0,19
Futures Treasury PLC					
3,375 % fällig am 08.02.2044		1.000		736	0,25
GlaxoSmithKline Capital PLC					
1,625 % fällig am 12.05.2035		4.000		2.700	0,91
5,250 % fällig am 19.12.2033		105		104	0,04
6,375 % fällig am 09.03.2039		500		547	0,18
Grainger PLC					
3,000 % fällig am 03.07.2030		2.100		1.591	0,53
3,375 % fällig am 24.04.2028		100		83	0,03
Great Places Housing Group Ltd.					
4,750 % fällig am 22.10.2042		1.000		905	0,30
Greene King Finance PLC					
3,593 % fällig am 15.03.2035		721		582	0,20
4,064 % fällig am 15.03.2035		271		222	0,07
5,106 % fällig am 15.03.2034		2.154		1.898	0,64
5,318 % fällig am 15.09.2031		2.126		1.915	0,64
Guinness Partnership Ltd.					
4,000 % fällig am 24.10.2044		1.000		810	0,27
Haleon UK Capital PLC					
3,375 % fällig am 29.03.2038		1.920		1.456	0,49
Hexagon Housing Association Ltd.					
3,625 % fällig am 22.04.2048		1.300		888	0,30
High Speed Rail Finance PLC					
4,375 % fällig am 01.11.2038		1.500		1.301	0,44
Home Group Ltd.					
3,125 % fällig am 27.03.2043		1.300		884	0,30
HSBC Holdings PLC					
5,875 % fällig am 28.09.2026 (a)(b)		200		175	0,06
6,000 % fällig am 29.03.2040		600		527	0,18
Hyde Housing Association Ltd.					
1,750 % fällig am 18.08.2055		1.600		739	0,25
Jigsaw Funding PLC					
3,375 % fällig am 05.05.2052		800		575	0,19
John Lewis PLC					
4,250 % fällig am 18.12.2034		2.222		1.386	0,47
Juturna European Loan Conduit PLC					
5,064 % fällig am 10.08.2033		967		916	0,31
Karbon Homes Ltd.					
3,375 % fällig am 15.11.2047		300		220	0,07
Land Securities Capital Markets PLC					
2,625 % fällig am 22.09.2039		1.373		965	0,32
2,750 % fällig am 22.09.2059		301		175	0,06
LCR Finance PLC					
4,500 % fällig am 07.12.2038		75		72	0,02
Legal & General Group PLC					
4,500 % fällig am 01.11.2050		400		335	0,11
5,500 % fällig am 27.06.2064		100		91	0,03
5,625 % fällig am 24.03.2031 (a)(b)		900		696	0,23
Lendlease Europe Finance PLC					
3,500 % fällig am 02.12.2033		532		348	0,12
Liberty Living Finance PLC					
3,375 % fällig am 28.11.2029		600		487	0,16
Lloyds Banking Group PLC					
2,707 % fällig am 03.12.2035		127		92	0,03
6,625 % fällig am 02.06.2033		500		474	0,16
London & Quadrant Housing Trust					
2,000 % fällig am 31.03.2032		2.000		1.483	0,50
2,000 % fällig am 20.10.2038		1.200		741	0,25
3,125 % fällig am 28.02.2053		1.000		636	0,21
3,750 % fällig am 27.10.2049		300		217	0,07
4,625 % fällig am 05.12.2033		900		819	0,28
London Stock Exchange Group PLC					
1,625 % fällig am 06.04.2030		900		703	0,24
Longstone Finance PLC					
4,896 % fällig am 19.04.2036		100		89	0,03
M&G PLC					
5,560 % fällig am 20.07.2055		3.450		2.950	0,99
Manchester Airport Group Funding PLC					
2,875 % fällig am 30.09.2044		2.050		1.303	0,44
4,750 % fällig am 31.03.2034		500		454	0,15
Marks & Spencer PLC					
3,750 % fällig am 19.05.2026		100		90	0,03

BESCHREIBUNG		PAR (000S)		MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
Meadowhall Finance PLC					
4,988 % fällig am 12.07.2037	£	62	£	47	0,02
Metropolitan Housing Trust Ltd.					
1,875 % fällig am 28.07.2036		2.400		1.546	0,52
Mitchells & Butlers Finance PLC					
5,965 % fällig am 15.12.2025		37		36	0,01
6,002 % fällig am 15.12.2030	$	660		478	0,16
6,013 % fällig am 15.12.2030	£	523		470	0,16
6,876 % fällig am 15.09.2034		993		813	0,27
Morhomes PLC					
3,400 % fällig am 19.02.2040		4.200		3.185	1,07
Motability Operations Group PLC					
1,500 % fällig am 20.01.2041		800		455	0,15
2,125 % fällig am 18.01.2042		2.600		1.624	0,55
2,375 % fällig am 03.07.2039		1.400		947	0,32
4,875 % fällig am 17.01.2043		1.100		1.028	0,35
National Gas Transmission PLC					
5,750 % fällig am 05.04.2035		1.850		1.761	0,59
National Grid Electricity Distribution East Midlands PLC					
6,250 % fällig am 10.12.2040		500		514	0,17
National Grid Electricity Distribution South Wales PLC					
1,625 % fällig am 07.10.2035		1.100		694	0,23
National Grid Electricity Distribution South West PLC					
5,750 % fällig am 23.03.2040		700		682	0,23
National Grid Electricity Transmission PLC					
2,000 % fällig am 16.09.2038		1.200		732	0,25
2,000 % fällig am 17.04.2040		2.008		1.178	0,40
2,750 % fällig am 06.02.2035		600		438	0,15
5,272 % fällig am 18.01.2043		2.000		1.834	0,62
Nationwide Building Society					
5,875 % fällig am 20.12.2024 (a)(b)		700		655	0,22
Nats En Route PLC					
1,750 % fällig am 30.09.2033		400		280	0,09
NatWest Group PLC					
3,619 % fällig am 29.03.2029		2.000		1.719	0,58
4,600 % fällig am 28.06.2031 (a)(b)	$	600		328	0,11
Network Rail Infrastructure Finance PLC					
4,750 % fällig am 29.11.2035	£	400		397	0,13
NIE Finance PLC					
5,875 % fällig am 01.12.2032		400		396	0,13
Northern Electric Finance PLC					
2,750 % fällig am 24.05.2049		2.150		1.365	0,46
Northern Gas Networks Finance PLC					
4,875 % fällig am 15.11.2035		900		796	0,27
5,625 % fällig am 23.03.2040		800		746	0,25
Northern Powergrid Northeast PLC					
1,875 % fällig am 16.06.2062		100		47	0,02
3,250 % fällig am 01.04.2052		600		413	0,14
Northern Powergrid Yorkshire PLC					
2,250 % fällig am 09.10.2059		1.000		522	0,18
5,125 % fällig am 04.05.2035		710		666	0,22
Northumbrian Water Finance PLC					
4,500 % fällig am 14.02.2031		800		717	0,24
5,625 % fällig am 29.04.2033		400		383	0,13
6,375 % fällig am 28.10.2034		1.020		1.025	0,34
Notting Hill Genesis					
2,000 % fällig am 03.06.2036		2.534		1.660	0,56
3,250 % fällig am 12.10.2048		1.141		761	0,26
5,250 % fällig am 07.07.2042		199		185	0,06
Orbit Capital PLC					
3,375 % fällig am 14.06.2048		700		483	0,16
Pacific Quay Finance PLC					
5,565 % fällig am 25.07.2034		768		743	0,25
Paragon Treasury PLC					
2,000 % fällig am 07.05.2036		1.300		843	0,28
Peabody Capital PLC					
3,250 % fällig am 14.09.2048		2.400		1.615	0,54
5,250 % fällig am 17.03.2043		300		281	0,09
Places for People Treasury PLC					
2,500 % fällig am 26.01.2036		1.100		753	0,25
Platform HG Financing PLC					
1,926 % fällig am 15.09.2041		1.200		735	0,25
Prudential Funding Asia PLC					
6,125 % fällig am 19.12.2031		620		599	0,20
RHP Finance PLC					
3,250 % fällig am 05.02.2048		700		503	0,17

BESCHREIBUNG		PAR (000S)		MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
Riverside Finance PLC					
3,875 % fällig am 05.12.2044	£	600	£	472	0,16
Sage Group PLC					
1,625 % fällig am 25.02.2031		1.000		735	0,25
2,875 % fällig am 08.02.2034		1.700		1.281	0,43
Sanctuary Capital PLC					
2,375 % fällig am 14.04.2050		1.000		572	0,19
5,000 % fällig am 26.04.2047		500		457	0,15
Scottish Hydro Electric Transmission PLC					
2,125 % fällig am 24.03.2036		3.300		2.208	0,74
2,250 % fällig am 27.09.2035		400		277	0,09
Segro PLC					
5,750 % fällig am 20.06.2035		300		294	0,10
Severn Trent Utilities Finance PLC					
2,000 % fällig am 02.06.2040		1.800		1.050	0,35
2,625 % fällig am 22.02.2033		556		421	0,14
4,625 % fällig am 30.11.2034		300		267	0,09
4,875 % fällig am 24.01.2042		1.300		1.140	0,38
5,250 % fällig am 04.04.2036		300		280	0,09
Society of Lloyd's					
4,875 % fällig am 07.02.2047		1.800		1.624	0,55
South Eastern Power Networks PLC					
1,750 % fällig am 30.09.2034		5.000		3.374	1,12
Southern Electric Power Distribution PLC					
4,625 % fällig am 20.02.2037		1.500		1.312	0,44
Southern Gas Networks PLC					
3,100 % fällig am 15.09.2036		2.100		1.515	0,51
6,375 % fällig am 15.05.2040		600		601	0,20
Southern Housing					
2,375 % fällig am 08.10.2036		1.500		1.029	0,35
3,500 % fällig am 19.10.2047		1.400		978	0,33
Sovereign Housing Capital PLC					
2,375 % fällig am 04.11.2048		200		117	0,04
5,705 % fällig am 10.09.2039		700		710	0,24
Standard Chartered PLC					
4,375 % fällig am 18.01.2038		900		799	0,27
5,125 % fällig am 06.06.2034		500		429	0,14
Telereal Secured Finance PLC					
4,010 % fällig am 10.12.2033		1.234		1.088	0,37
Telereal Securitisation PLC					
6,165 % fällig am 10.12.2033		85		81	0,03
Tesco Corporate Treasury Services PLC					
5,500 % fällig am 27.02.2035		1.800		1.664	0,56
Tesco Property Finance PLC					
5,411 % fällig am 13.07.2044		1.993		1.780	0,60
5,661 % fällig am 13.10.2041		190		174	0,06
5,744 % fällig am 13.04.2040		2.887		2.681	0,90
5,801 % fällig am 13.10.2040		325		303	0,10
6,052 % fällig am 13.10.2039		113		108	0,04
Thames Water Utilities Finance PLC					
2,375 % fällig am 22.04.2040		1.100		632	0,21
2,625 % fällig am 24.01.2032		300		221	0,07
4,375 % fällig am 03.07.2034		3.700		2.987	1,00
4,625 % fällig am 04.06.2046		700		528	0,18
5,125 % fällig am 28.09.2037		800		668	0,22
5,500 % fällig am 11.02.2041		200		172	0,06
TP ICAP Finance PLC					
2,625 % fällig am 18.11.2028		2.000		1.479	0,50
Travis Perkins PLC					
3,750 % fällig am 17.02.2026		300		270	0,09
Unique Pub Finance Co. PLC					
5,659 % fällig am 30.06.2027		1.012		992	0,33
7,395 % fällig am 28.03.2024		412		413	0,14
United Utilities Water Finance PLC					
1,875 % fällig am 03.06.2042		800		440	0,15
5,750 % fällig am 26.06.2036		1.700		1.674	0,56
University of Oxford					
2,544 % fällig am 08.12.2117		1.850		970	0,33
Virgin Media Secured Finance PLC					
4,250 % fällig am 15.01.2030		1.100		868	0,29
Vodafone Group PLC					
3,000 % fällig am 12.08.2056		2.100		1.171	0,39
3,375 % fällig am 08.08.2049		3.900		2.480	0,83
Weir Group PLC					
6,875 % fällig am 14.06.2028		700		691	0,23
Wellcome Trust Finance PLC					
4,625 % fällig am 25.07.2036		500		481	0,16

BESCHREIBUNG		PAR (000S)		MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
Wellcome Trust Ltd.					
1,500 % fällig am 14.07.2071	£	5.600	£	2.220	0,75
2,517 % fällig am 07.02.2118		1.500		782	0,26
4,000 % fällig am 09.05.2059		400		348	0,12
Workspace Group PLC					
2,250 % fällig am 11.03.2028		450		330	0,11
Yorkshire Housing Finance PLC					
4,125 % fällig am 31.10.2044		800		637	0,21
Yorkshire Water Finance PLC					
1,750 % fällig am 27.10.2032		715		499	0,17
2,750 % fällig am 18.04.2041		1.100		705	0,24
5,500 % fällig am 28.04.2035		1.300		1.221	0,41
				157.177	52,75
NON-AGENCY-MBS					
Atlas Funding PLC					
5,937 % fällig am 20.01.2061		594		595	0,20
Avon Finance PLC					
5,809 % fällig am 20.09.2048		719		718	0,24
Great Hall Mortgages PLC					
3,697 % fällig am 18.06.2038	€	6		5	0,00
5,152 % fällig am 18.03.2039	£	6		6	0,00
Hops Hill PLC					
5,854 % fällig am 27.05.2054		394		394	0,13
Mansard Mortgages PLC					
5,651 % fällig am 15.12.2049		124		122	0,04
Mortimer BTL PLC					
5,614 % fällig am 23.06.2053		1.006		995	0,34
5,976 % fällig am 23.03.2054		775		775	0,26
Newgate Funding PLC					
4,126 % fällig am 15.12.2050	€	1.234		1.021	0,34
5,038 % fällig am 01.12.2050	£	60		57	0,02
Pierpont BTL PLC					
0,000 % fällig am 21.09.2054		900		898	0,30
Polaris PLC					
5,631 % fällig am 23.12.2058		534		531	0,18
Stratton Mortgage Funding PLC					
5,391 % fällig am 20.07.2060		651		651	0,22
Towd Point Mortgage Funding PLC					
5,635 % fällig am 20.10.2051		574		575	0,19
Twin Bridges PLC					
5,715 % fällig am 12.03.2055		702		699	0,24
				8.042	2,70

BESCHREIBUNG		PAR (000S)		MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
STAATSEMISSIONEN					
United Kingdom Gilt					
1,250 % fällig am 31.07.2051	£	21.600	£	10.718	3,60
1,500 % fällig am 31.07.2053		400		209	0,07
1,750 % fällig am 22.07.2057		3.800		2.109	0,71
3,250 % fällig am 22.01.2044 (c)		3.300		2.747	0,92
3,750 % fällig am 22.10.2053		2.800		2.490	0,83
				18.273	6,13
Summe Großbritannien				183.492	61,58
USA					
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL					
Apple, Inc.					
3,600 % fällig am 31.07.2042		1.400		1.164	0,39
AT&T, Inc.					
4,250 % fällig am 01.06.2043		5.113		3.913	1,31
4,875 % fällig am 01.06.2044		4.038		3.352	1,13
Berkshire Hathaway Finance Corp.					
2,375 % fällig am 19.06.2039		400		272	0,09
2,625 % fällig am 19.06.2059		100		59	0,02
Charter Communications Operating LLC					
5,125 % fällig am 01.07.2049	$	500		310	0,10
Citigroup, Inc.					
6,800 % fällig am 25.06.2038	£	2.000		2.213	0,74
7,375 % fällig am 01.09.2039		100		118	0,04
Comcast Corp.					
1,875 % fällig am 20.02.2036		2.400		1.608	0,54
Credit Suisse AG AT1 Claim ^	$	1.600		50	0,02
Eli Lilly & Co.					
1,625 % fällig am 14.09.2043	£	700		398	0,13
Entergy Corp.					
3,750 % fällig am 15.06.2050	$	57		33	0,01
Goldman Sachs Group, Inc.					
3,625 % fällig am 29.10.2029	£	2.300		1.987	0,67
6,875 % fällig am 18.01.2038		500		499	0,17
International Business Machines Corp.					
4,875 % fällig am 06.02.2038		200		179	0,06
JPMorgan Chase & Co.					
1,895 % fällig am 28.04.2033		1.400		1.016	0,34
McDonald's Corp.					
2,950 % fällig am 15.03.2034		400		314	0,11
3,750 % fällig am 31.05.2038		2.100		1.679	0,56

BESCHREIBUNG		PAR (000S)		MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
Mondelez International, Inc.					
3,875 % fällig am 06.03.2045	£	100	£	74	0,03
Morgan Stanley					
5,789 % fällig am 18.11.2033		800		768	0,26
National Fuel Gas Co.					
2,950 % fällig am 01.03.2031	$	159		100	0,03
Pfizer, Inc.					
2,735 % fällig am 15.06.2043	£	4.600		3.142	1,06
Realty Income Corp.					
1,750 % fällig am 13.07.2033		1.100		736	0,25
2,500 % fällig am 14.01.2042		500		302	0,10
Time Warner Cable LLC					
5,250 % fällig am 15.07.2042		2.986		2.367	0,79
Verizon Communications, Inc.					
1,875 % fällig am 03.11.2038		2.700		1.603	0,54
3,125 % fällig am 02.11.2035		600		452	0,15
3,375 % fällig am 27.10.2036		2.800		2.132	0,72
4,750 % fällig am 17.02.2034		1.000		905	0,30
Walmart, Inc.					
5,250 % fällig am 28.09.2035		2.000		2.006	0,67
5,625 % fällig am 27.03.2034		1.600		1.655	0,56
Wells Fargo & Co.					
2,125 % fällig am 24.09.2031		400		296	0,10
4,625 % fällig am 02.11.2035		1.729		1.529	0,51
4,875 % fällig am 29.11.2035		1.700		1.442	0,48
Welltower OP LLC					
4,500 % fällig am 01.12.2034		1.000		821	0,28
				39.494	13,26
NON-AGENCY-MBS					
Deutsche ALT-A Securities, Inc. Mortgage Loan Trust					
5,650 % fällig am 25.04.2035	$	144		100	0,03
GSR Mortgage Loan Trust					
4,662 % fällig am 25.09.2035		0		0	0,00
Mellon Residential Funding Corp. Mortgage Pass-Through Trust					
5,633 % fällig am 15.12.2030		3		3	0,00
Sequoia Mortgage Trust					
3,565 % fällig am 20.07.2037 ^		6		4	0,00
				107	0,03
Summe USA				39.601	13,29
Summe Übertragbare Wertpapiere			£	**289.477**	**97,16**

PENSIONSGESCHÄFTE

Kontrahent	Kredit-zins	Abrechnungs-datum	Fälligkeits-datum		Kapital-betrag	Besichert durch		Sicherheiten (erhalten)		Pensions-geschäfte, zum Wert		Zu erhaltende Erlöse aus Pensions-geschäft[1]	% des Nettovermögens
FICC	2,400 %	30.06.2023	03.07.2023	$	410	U.S. Treasury Notes 4,625 % fällig am 30.06.2025	£	(329)	£	322	£	322	0,11
SCX	4,900	30.06.2023	03.07.2023	£	1.600	United Kingdom Gilt 1,250 % fällig am 22.10.2041		(1.644)		1.600		1.601	0,54
Summe Pensionsgeschäfte							**£**	**(1.973)**	**£**	**1.922**	**£**	**1.923**	**0,65**

[1] Umfasst aufgelaufene Zinsen.

AN EINEM GEREGELTEN MARKT GEHANDELTE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*, außer Anzahl der Kontrakte)

*** Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt**

FUTURES

Beschreibung	Art	Ablauf-monat	Anzahl der Kontrakte		Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Euro-Bund 10-Year Bond September Futures	Short	09.2023	19	£	21	0,01
Euro-Buxl 30-Year Bond September Futures	Long	09.2023	2		6	0,00
Euro-Schatz September Futures	Long	09.2023	46		(35)	(0,01)
Japan Government 10-Year Bond September Futures	Short	09.2023	6		(18)	(0,01)
U.S. Treasury 2-Year Note September Futures	Short	09.2023	12		27	0,01
U.S. Treasury 10-Year Note September Futures	Long	09.2023	29		(47)	(0,02)
U.S. Treasury 10-Year Ultra September Futures	Long	09.2023	24		1	0,00
U.S. Treasury 30-Year Bond September Futures	Long	09.2023	14		6	0,00
U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond September Futures	Long	09.2023	20		(13)	0,00
United Kingdom Long Gilt September Futures	Long	09.2023	5		(8)	0,00
				£	(60)	(0,02)
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate				**£**	**(60)**	**(0,02)**

ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)

*** Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt**

ZINSSWAPS

Zahlung/ Erhalt variabel Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fester Zinssatz	Fälligkeits-datum		Nenn-betrag		Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Zahlung[1]	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	3,250 %	20.09.2053	£	11.900	£	(142)	(0,05)
Zahlung[1]	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	3,500	20.09.2033		20.900		(1.138)	(0,38)
Erhalt[1]	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	3,750	20.09.2028		11.700		521	0,18
Zahlung[1]	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	4,000	20.09.2025		3.400		(52)	(0,02)
Erhalt[1]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,000	16.12.2030	$	3.700		484	0,16
Erhalt[1]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,250	16.12.2050		100		27	0,01
Erhalt[1]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,500	18.12.2029		2.700		424	0,14
Erhalt[1]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,625	16.01.2050		100		34	0,01
Erhalt[1]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,750	21.06.2047		1.300		423	0,14
Erhalt[1]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,750	18.12.2049		400		136	0,05
Erhalt[1]	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	2,000	12.02.2045		6.600		2.161	0,73
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,000	16.09.2023		3.700		34	0,01
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,250	16.09.2023		100		1	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,500	18.09.2023		3.500		28	0,01
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,625	16.07.2023		100		0	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,750	18.09.2023		400		3	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	1,750	21.09.2023		1.300		10	0,00
Erhalt	3-Month USD-LIBOR	2,000	12.08.2023		6.600		21	0,01
Erhalt[1]	6-Month EUR-EURIBOR	2,500	20.09.2053	€	500		(8)	0,00
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	2,547	09.03.2033		1.400		(23)	(0,01)
Erhalt[1]	6-Month EUR-EURIBOR	3,000	20.09.2028		500		1	0,00
Erhalt[1]	6-Month EUR-EURIBOR	3,500	20.09.2025		4.300		(3)	0,00
						£	2.942	0,99
Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate						**£**	**2.942**	**0,99**

[1] Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft.

DERIVATIVE OTC-FINANZINSTRUMENTE (Beträge in Tausend*, außer Anzahl der Kontrakte)

*** Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt**

DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung		Zu erhaltende Währung		Nicht realisierte Wertzunahme		Nicht realisierte (Wertabnahme)		Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)		% des Nettovermögens
BRC	08.2023	£	710	€	815	£	0	£	(9)	£	(9)	0,00
	08.2023		362	$	448		0		(10)		(10)	0,00
	08.2023	$	733	£	584		7		0		7	0,00
DUB	08.2023	£	1.769	$	2.200		0		(39)		(39)	(0,01)
JPM	08.2023	€	4.896	£	4.266		56		0		56	0,02
	08.2023	$	8.166		6.448		26		0		26	0,01
MBC	08.2023	£	3.435	€	3.948		1		(42)		(41)	(0,01)
	08.2023		2.647	$	3.320		4		(40)		(36)	(0,01)
	08.2023	¥	27.000	£	161		13		0		13	0,00
	08.2023	$	655		511		0		(4)		(4)	0,00
MYI	08.2023	£	650	€	753		0		(3)		(3)	0,00
	08.2023		683	$	854		0		(11)		(11)	0,00
RBC	08.2023		1.326	€	1.526		1		(15)		(14)	(0,01)
	08.2023		2.966	$	3.677		0		(76)		(76)	(0,03)
	08.2023	$	1.575	£	1.246		8		0		8	0,00
SCX	08.2023	€	7.746		6.764		104		0		104	0,03
	08.2023	£	351	$	441		0		(4)		(4)	0,00
TOR	08.2023		1.275		1.598		0		(18)		(18)	(0,01)
UAG	08.2023		522	€	606		0		(1)		(1)	0,00
	08.2023		1.835	$	2.282		0		(40)		(40)	(0,01)
	08.2023	$	7.138	£	5.648		34		0		34	0,01
						£	254	£	(312)	£	(58)	(0,02)
Summe Freiverkehrsfinanzderivate										**£**	**(58)**	**(0,02)**
Summe Anlagen										**£**	**294.223**	**98,76**
Sonstige Aktiva und Passiva										**£**	**3.689**	**1,24**
Nettovermögen										**£**	**297.912**	**100,00**

ERLÄUTERUNGEN ZUR AUFSTELLUNG DES WERTPAPIERBESTANDS (Angaben in Tausend*):

***** **Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt**

^ **Das Wertpapier ist in Verzug.**

(a) Unbegrenzte Laufzeit; das gegebenenfalls angegebene Datum stellt den nächsten vertraglichen Kündigungstermin dar.

(b) Bedingt wandelbares Wertpapier.

(c) Wertpapier mit einem gesamten beizulegenden Zeitwert von 2.747 GBP (31. Dezember 2022: null GBP) wurden zum 30. Juni 2023 gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte als Sicherheit verpfändet.

Barmittel in Höhe von 4.147 GBP (31. Dezember 2022: 10.123 GBP) wurden zum 30. Juni 2023 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Beizulegender Zeitwert[1]

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 30. Juni 2023 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie[2]	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	£ 0	£ 289.477	£ 0	£ 289.477
Pensionsgeschäfte	0	1.922	0	1.922
Finanzderivate[3]	(34)	2.858	0	2.824
Summen	**£ (34)**	**£ 294.257**	**£ 0**	**£ 294.223**

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 31. Dezember 2022 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie[2]	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	£ 0	£ 309.110	£ 0	£ 309.110
Pensionsgeschäfte	0	269	0	269
Finanzderivate[3]	(1.767)	6.087	0	4.320
Summen	**£ (1.767)**	**£ 315.466**	**£ 0**	**£ 313.699**

(1) Weitere Informationen finden Sie in den Erläuterungen in Erläuterung 3.

(2) Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung des Wertpapierbestands.

(3) Finanzderivate können offene Terminkontrakte, Swap-, Verkaufs- oder Kaufoptionen sowie Devisenterminkontrakte enthalten.

Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2023:

Kontrahent	Kredit-zins	Abrechnungs-datum	Fälligkeits-datum	Kredit-betrag	Verbindlichkeiten aus umgekehrten Pensions-geschäften	% des Nettovermögens
SCX	4,650 %	16.05.2023	08.08.2023	£ (2.898)	£ (2.915)	(0,98)
Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte					**£ (2.915)**	**(0,98)**

Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC-Finanzderivate und -Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2023 und 31. Dezember 2022**:**

	Zum 30. Jun. 2023			Zum 31. Dez. 2022		
Kontrahent	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-engagement[1]	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-engagement[1]
BOA	£ k. A.	£ k. A.	£ k. A.	£ 408	£ (510)	£ (102)
BRC	(12)	0	(12)	1	0	1
DUB	(39)	0	(39)	k. A.	k. A.	k. A.
GLM	k. A.	k. A.	k. A.	(76)	0	(76)
JPM	82	0	82	48	0	48
MBC	(68)	0	(68)	9	0	9
MYI	(14)	0	(14)	2	0	2
RBC	(82)	0	(82)	k. A.	k. A.	k. A.
SCX	100	0	100	(4)	0	(4)
SBB	k. A.	k. A.	k. A.	(239)	0	(239)
TOR	(18)	0	(18)	k. A.	k. A.	k. A.
UAG	(7)	0	(7)	(12)	0	(12)

(1) Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären.

Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung des Wertpapierbestands zum 30. Juni 2023:

	30. Jun. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	96,29	93,60
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	0,85	1,51
Sonstige übertragbare Wertpapiere	0,02	k. A.
Pensionsgeschäfte	0,65	0,08
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	(0,02)	(0,54)
Zentral abgerechnete Finanzderivate	0,99	1,83
Freiverkehrsfinanzderivate	(0,02)	0,04
Umgekehrte Pensionsgeschäfte	(0,98)	k. A.

Das Anlageportfolio des Fonds konzentriert sich zum 30. Juni 2023 auf die folgenden Segmente**:**

Anlagen zum Marktwert	30. Jun. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
Australien	0,14	k. A.
Belgien	k. A.	0,19
Cayman-Inseln	0,58	k. A.
Dänemark	1,25	1,23
Frankreich	6,17	5,11
Deutschland	0,46	2,80
Indien	k. A.	0,05
Irland	1,96	2,32
Italien	0,90	0,78
Japan	k. A.	0,09
Jersey, Kanalinseln	3,33	2,73
Luxemburg	0,46	1,21
Mexiko	0,14	0,13
Niederlande	5,53	5,45
Norwegen	0,21	0,27
Singapur	0,35	0,33
Spanien	k. A.	0,22
Supranational	0,37	1,18
Schweden	0,44	0,16
Schweiz	k. A.	1,21
Großbritannien	61,58	52,18
USA	13,29	13,85
Kurzfristige Instrumente	k. A.	3,62
Pensionsgeschäfte	0,65	0,08
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	(0,02)	(0,54)
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	k. A.	0,05
Credit Default Swaps auf Kreditindizes— Schutzverkauf	k. A.	0,14
Zinsswaps	0,99	1,64
Freiverkehrsfinanzderivate		
Verkaufsoptionen		
Credit Default Swaptions auf Kreditindizes	k. A.	0,00
Zinsswapoptionen	k. A.	(0,02)
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	k. A.	0,01
Devisenterminkontrakte	(0,02)	0,05
Sonstige Aktiva und Passiva	1,24	3,48
Nettovermögen	100,00	100,00

BESCHREIBUNG		PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE				
KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG				
Heartland Dental LLC				
10,102 % fällig am 28.04.2028	$	4.983	$ 4.819	0,24
Intelsat Jackson Holdings S.A.				
9,443 % fällig am 01.02.2029		2.779	2.771	0,14
Serta Simmons Bedding LLC				
8,098 % - 8,117 % fällig am 08.11.2023		3.101	132	0,01
Team Health Holdings, Inc.				
7,943 % fällig am 06.02.2024		5.780	5.140	0,26
			12.862	0,65
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
BANKEN UND FINANZEN				
Alliant Holdings Intermediate LLC				
4,250 % fällig am 15.10.2027		5.000	4.494	0,23
6,750 % fällig am 15.04.2028		2.750	2.730	0,14
Allied Universal Holdco LLC				
4,625 % fällig am 01.06.2028		3.000	2.543	0,13
Armor Holdco, Inc.				
8,500 % fällig am 15.11.2029		7.500	6.232	0,31
Burford Capital Global Finance LLC				
9,250 % fällig am 01.07.2031		6.250	6.219	0,31
Curo Group Holdings Corp.				
7,500 % fällig am 01.08.2028		4.000	1.515	0,08
Ford Motor Credit Co. LLC				
2,900 % fällig am 16.02.2028		5.000	4.287	0,22
2,900 % fällig am 10.02.2029		8.000	6.628	0,34
3,375 % fällig am 13.11.2025		5.000	4.654	0,24
3,664 % fällig am 08.09.2024		3.000	2.902	0,15
4,000 % fällig am 13.11.2030		7.500	6.416	0,32
4,125 % fällig am 17.08.2027		5.000	4.570	0,23
4,134 % fällig am 04.08.2025		5.000	4.747	0,24
4,542 % fällig am 01.08.2026		2.000	1.882	0,10
5,113 % fällig am 03.05.2029		3.000	2.785	0,14
5,125 % fällig am 16.06.2025		2.500	2.434	0,12
Fortress Transportation & Infrastructure Investors LLC				
6,500 % fällig am 01.10.2025		3.222	3.177	0,16
Getty Images, Inc.				
9,750 % fällig am 01.03.2027		8.250	8.157	0,41
Greystar Real Estate Partners LLC				
5,750 % fällig am 01.12.2025		2.000	1.955	0,10
HAT Holdings LLC				
3,375 % fällig am 15.06.2026		2.600	2.333	0,12
3,750 % fällig am 15.09.2030		4.600	3.613	0,18
Howard Hughes Corp.				
4,125 % fällig am 01.02.2029		1.000	829	0,04
4,375 % fällig am 01.02.2031		2.750	2.197	0,11
5,375 % fällig am 01.08.2028		2.500	2.228	0,11
Intesa Sanpaolo SpA				
5,710 % fällig am 15.01.2026		1.000	953	0,05
7,700 % fällig am 17.09.2025 (f)(h)		4.000	3.765	0,19
Midcap Financial Issuer Trust				
5,625 % fällig am 15.01.2030		2.000	1.590	0,08
6,500 % fällig am 01.05.2028		2.000	1.782	0,09
MPT Operating Partnership LP				
3,500 % fällig am 15.03.2031		2.000	1.380	0,07
Nationstar Mortgage Holdings, Inc.				
5,125 % fällig am 15.12.2030		5.000	4.061	0,21
NCL Finance Ltd.				
6,125 % fällig am 15.03.2028		2.000	1.802	0,09
OneMain Finance Corp.				
3,500 % fällig am 15.01.2027		4.000	3.436	0,17
4,000 % fällig am 15.09.2030		3.000	2.313	0,12
5,375 % fällig am 15.11.2029		3.000	2.553	0,13
6,625 % fällig am 15.01.2028		1.500	1.416	0,07
6,875 % fällig am 15.03.2025		1.000	991	0,05
7,125 % fällig am 15.03.2026		3.000	2.950	0,15
Park Intermediate Holdings LLC				
4,875 % fällig am 15.05.2029		1.000	863	0,04
5,875 % fällig am 01.10.2028		1.500	1.378	0,07
PennyMac Financial Services, Inc.				
5,375 % fällig am 15.10.2025		1.000	946	0,05
5,750 % fällig am 15.09.2031		2.000	1.633	0,08
Rocket Mortgage LLC				
3,625 % fällig am 01.03.2029	$	1.000	$ 841	0,04
3,875 % fällig am 01.03.2031		2.000	1.624	0,08
4,000 % fällig am 15.10.2033		2.000	1.566	0,08
SBA Communications Corp.				
3,125 % fällig am 01.02.2029		10.000	8.486	0,43
Voyager Aviation Holdings LLC				
8,500 % fällig am 09.05.2026		1.805	1.426	0,07
			137.282	6,94
INDUSTRIEWERTE				
24 Hour Fitness Worldwide, Inc.				
8,000 % fällig am 01.06.2022 ^		9.500	24	0,00
Academy Ltd.				
6,000 % fällig am 15.11.2027		4.000	3.844	0,19
AdaptHealth LLC				
6,125 % fällig am 01.08.2028		3.000	2.602	0,13
Adient Global Holdings Ltd.				
4,875 % fällig am 15.08.2026		3.000	2.853	0,14
ADT Security Corp.				
4,875 % fällig am 15.07.2032		4.000	3.426	0,17
Advantage Sales & Marketing, Inc.				
6,500 % fällig am 15.11.2028		5.000	4.233	0,21
Ahead DB Holdings LLC				
6,625 % fällig am 01.05.2028		10.000	8.144	0,41
Ahlstrom Holding 3 Oy				
4,875 % fällig am 04.02.2028		4.000	3.326	0,17
Air Canada				
3,875 % fällig am 15.08.2026		2.500	2.319	0,12
4,625 % fällig am 15.08.2029	CAD	1.750	1.193	0,06
Albertsons Cos., Inc.				
3,500 % fällig am 15.03.2029	$	2.000	1.733	0,09
4,625 % fällig am 15.01.2027		1.500	1.423	0,07
5,875 % fällig am 15.02.2028		1.500	1.459	0,07
6,500 % fällig am 15.02.2028		5.000	5.014	0,25
Albion Financing SARL				
6,125 % fällig am 15.10.2026		4.250	3.999	0,20
Allison Transmission, Inc.				
3,750 % fällig am 30.01.2031		5.000	4.228	0,21
Altice Financing S.A.				
5,000 % fällig am 15.01.2028		4.000	3.201	0,16
Altice France Holding S.A.				
6,000 % fällig am 15.02.2028		5.000	2.444	0,12
10,500 % fällig am 15.05.2027		3.000	1.820	0,09
Altice France S.A.				
5,125 % fällig am 15.01.2029		3.000	2.142	0,11
5,125 % fällig am 15.07.2029		4.000	2.844	0,14
5,500 % fällig am 15.01.2028		8.000	6.050	0,31
5,500 % fällig am 15.10.2029		2.000	1.432	0,07
8,125 % fällig am 01.02.2027		3.000	2.601	0,13
AMC Networks, Inc.				
4,250 % fällig am 15.02.2029		5.000	2.693	0,14
4,750 % fällig am 01.08.2025		5.700	4.991	0,25
American Airlines Pass-Through Trust				
3,375 % fällig am 01.11.2028		2.102	1.887	0,10
American Airlines, Inc.				
5,500 % fällig am 20.04.2026		5.700	5.652	0,29
5,750 % fällig am 20.04.2029		14.950	14.530	0,74
7,250 % fällig am 15.02.2028		700	697	0,04
Antero Resources Corp.				
5,375 % fällig am 01.03.2030		1.500	1.390	0,07
Apache Corp.				
4,875 % fällig am 15.11.2027		4.000	3.716	0,19
APi Group DE, Inc.				
4,750 % fällig am 15.10.2029		4.000	3.607	0,18
Arches Buyer, Inc.				
4,250 % fällig am 01.06.2028		3.500	3.050	0,15
6,125 % fällig am 01.12.2028 (j)		4.000	3.451	0,17
Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC				
3,250 % fällig am 01.09.2028		2.000	1.720	0,09
4,000 % fällig am 01.09.2029		2.000	1.586	0,08
Ascent Resources Utica Holdings LLC				
5,875 % fällig am 30.06.2029		2.000	1.786	0,09
8,250 % fällig am 31.12.2028		1.000	984	0,05
ASP Unifrax Holdings, Inc.				
5,250 % fällig am 30.09.2028		2.000	1.446	0,07
7,500 % fällig am 30.09.2029	$	2.000	$ 1.240	0,06
Athenahealth Group, Inc.				
6,500 % fällig am 15.02.2030		10.000	8.426	0,43
Avantor Funding, Inc.				
4,625 % fällig am 15.07.2028		6.000	5.567	0,28
Axalta Coating Systems LLC				
3,375 % fällig am 15.02.2029		5.000	4.261	0,22
B.C. Ltd.				
9,000 % fällig am 30.01.2028		2.150	2.158	0,11
B.C. Unlimited Liability Co.				
3,500 % fällig am 15.02.2029		2.250	1.975	0,10
3,875 % fällig am 15.01.2028		2.000	1.830	0,09
4,000 % fällig am 15.10.2030		4.000	3.428	0,17
4,375 % fällig am 15.01.2028		2.000	1.849	0,09
Ball Corp.				
2,875 % fällig am 15.08.2030		5.000	4.155	0,21
6,000 % fällig am 15.06.2029		1.750	1.739	0,09
Bath & Body Works, Inc.				
6,625 % fällig am 01.10.2030		2.000	1.933	0,10
6,875 % fällig am 01.11.2035		3.000	2.750	0,14
9,375 % fällig am 01.07.2025		1.438	1.528	0,08
Bausch Health Cos., Inc.				
4,875 % fällig am 01.06.2028		2.000	1.193	0,06
5,500 % fällig am 01.11.2025		3.500	3.097	0,16
5,750 % fällig am 15.08.2027		1.000	614	0,03
11,000 % fällig am 30.09.2028		2.750	1.960	0,10
14,000 % fällig am 15.10.2030		760	456	0,02
BCPE Empire Holdings, Inc.				
7,625 % fällig am 01.05.2027		11.900	11.080	0,56
Bellis Acquisition Co. PLC				
3,250 % fällig am 16.02.2026	£	2.500	2.668	0,14
Black Knight InfoServ LLC				
3,625 % fällig am 01.09.2028	$	3.000	2.693	0,14
Block, Inc.				
3,500 % fällig am 01.06.2031		5.000	4.148	0,21
Bombardier, Inc.				
6,000 % fällig am 15.02.2028		3.000	2.839	0,14
7,125 % fällig am 15.06.2026		5.000	4.972	0,25
7,500 % fällig am 15.03.2025		854	857	0,04
7,500 % fällig am 01.02.2029		2.000	1.979	0,10
7,875 % fällig am 15.04.2027		6.000	5.993	0,30
Boyne USA, Inc.				
4,750 % fällig am 15.05.2029		2.500	2.255	0,11
Buckeye Partners LP				
4,125 % fällig am 01.03.2025		2.000	1.904	0,10
4,500 % fällig am 01.03.2028		2.000	1.794	0,09
Builders FirstSource, Inc.				
5,000 % fällig am 01.03.2030		5.000	4.680	0,24
CAB SELAS				
3,375 % fällig am 01.02.2028	€	5.000	4.459	0,23
Cablevision Lightpath LLC				
5,625 % fällig am 15.09.2028	$	4.000	2.968	0,15
Caesars Entertainment, Inc.				
4,625 % fällig am 15.10.2029		9.000	7.867	0,40
7,000 % fällig am 15.02.2030		2.000	2.010	0,10
8,125 % fällig am 01.07.2027		2.000	2.049	0,10
Callon Petroleum Co.				
7,500 % fällig am 15.06.2030		2.500	2.362	0,12
Capstone Borrower, Inc.				
8,000 % fällig am 15.06.2030		2.050	2.026	0,10
Cargo Aircraft Management, Inc.				
4,750 % fällig am 01.02.2028		1.000	877	0,04
Carnival Corp.				
4,000 % fällig am 01.08.2028		5.000	4.437	0,22
5,750 % fällig am 01.03.2027		4.000	3.686	0,19
6,000 % fällig am 01.05.2029		2.500	2.234	0,11
7,625 % fällig am 01.03.2026 (j)		4.000	3.921	0,20
Carnival PLC				
1,000 % fällig am 28.10.2029	€	5.000	3.431	0,17
Carvana Co.				
4,875 % fällig am 01.09.2029	$	2.000	1.137	0,06
5,500 % fällig am 15.04.2027		2.000	1.341	0,07
Catalent Pharma Solutions, Inc.				
2,375 % fällig am 01.03.2028	€	2.000	1.766	0,09
3,125 % fällig am 15.02.2029	$	6.000	4.884	0,25
CCO Holdings LLC				
4,250 % fällig am 01.02.2031		10.000	8.099	0,41

BESCHREIBUNG		PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
4,250 % fällig am 15.01.2034	$	3.000	$ 2.270	0,12
4,500 % fällig am 15.08.2030		10.000	8.336	0,42
4,500 % fällig am 01.05.2032		10.000	7.994	0,40
4,500 % fällig am 01.06.2033		7.000	5.504	0,28
4,750 % fällig am 01.03.2030		5.000	4.280	0,22
5,000 % fällig am 01.02.2028		2.000	1.824	0,09
5,375 % fällig am 01.06.2029		4.000	3.620	0,18
CDI Escrow Issuer, Inc.				
5,750 % fällig am 01.04.2030		2.000	1.863	0,09
Central Garden & Pet Co.				
4,125 % fällig am 15.10.2030		5.000	4.195	0,21
Charles River Laboratories International, Inc.				
3,750 % fällig am 15.03.2029		2.000	1.762	0,09
4,000 % fällig am 15.03.2031		1.000	870	0,04
Cheplapharm Arzneimittel GmbH				
5,500 % fällig am 15.01.2028		500	453	0,02
Chesapeake Energy Corp.				
6,750 % fällig am 15.04.2029		7.500	7.449	0,38
Chobani LLC				
4,625 % fällig am 15.11.2028		2.000	1.823	0,09
Churchill Downs, Inc.				
4,750 % fällig am 15.01.2028		5.000	4.643	0,24
Clarios Global LP				
4,375 % fällig am 15.05.2026	€	5.000	5.216	0,26
6,250 % fällig am 15.05.2026	$	1.750	1.741	0,09
6,750 % fällig am 15.05.2028		5.000	4.988	0,25
Clarivate Science Holdings Corp.				
4,875 % fällig am 01.07.2029		5.000	4.441	0,22
Clear Channel International BV				
6,625 % fällig am 01.08.2025		2.000	1.993	0,10
Clear Channel Outdoor Holdings, Inc.				
5,125 % fällig am 15.08.2027		3.000	2.728	0,14
7,750 % fällig am 15.04.2028		5.000	3.931	0,20
Cloud Software Group, Inc.				
6,500 % fällig am 31.03.2029		7.000	6.239	0,32
9,000 % fällig am 30.09.2029		4.000	3.498	0,18
Clydesdale Acquisition Holdings, Inc.				
8,750 % fällig am 15.04.2030		10.000	8.838	0,45
Coherent Corp.				
5,000 % fällig am 15.12.2029		4.000	3.615	0,18
CommScope Technologies LLC				
5,000 % fällig am 15.03.2027		2.000	1.395	0,07
6,000 % fällig am 15.06.2025		1.500	1.400	0,07
CommScope, Inc.				
4,750 % fällig am 01.09.2029		4.500	3.552	0,18
6,000 % fällig am 01.03.2026		2.500	2.333	0,12
Community Health Systems, Inc.				
4,750 % fällig am 15.02.2031		5.000	3.785	0,19
5,250 % fällig am 15.05.2030		3.000	2.366	0,12
5,625 % fällig am 15.03.2027		5.000	4.411	0,22
6,125 % fällig am 01.04.2030		1.500	895	0,05
6,875 % fällig am 15.04.2029		3.750	2.346	0,12
Comstock Resources, Inc.				
5,875 % fällig am 15.01.2030		2.000	1.739	0,09
6,750 % fällig am 01.03.2029		4.000	3.664	0,19
Connect Finco SARL				
6,750 % fällig am 01.10.2026		3.000	2.917	0,15
Consolidated Communications, Inc.				
5,000 % fällig am 01.10.2028		2.000	1.503	0,08
Coty, Inc.				
3,875 % fällig am 15.04.2026	€	3.000	3.181	0,16
5,000 % fällig am 15.04.2026	$	2.000	1.919	0,10
6,500 % fällig am 15.04.2026		1.500	1.488	0,08
Covanta Holding Corp.				
4,875 % fällig am 01.12.2029		750	650	0,03
5,000 % fällig am 01.09.2030		1.000	850	0,04
CQP Holdco LP				
5,500 % fällig am 15.06.2031		3.500	3.127	0,16
Crocs, Inc.				
4,250 % fällig am 15.03.2029		2.000	1.703	0,09
CSC Holdings LLC				
3,375 % fällig am 15.02.2031		4.000	2.711	0,14
4,125 % fällig am 01.12.2030		2.500	1.751	0,09
6,500 % fällig am 01.02.2029		2.000	1.619	0,08
Ctec GmbH				
5,250 % fällig am 15.02.2030	€	5.000	4.535	0,23
DaVita, Inc.				
3,750 % fällig am 15.02.2031	$	7.000	$ 5.606	0,28
4,625 % fällig am 01.06.2030		5.000	4.298	0,22
Dealer Tire LLC				
8,000 % fällig am 01.02.2028		1.245	1.136	0,06
Deluxe Corp.				
8,000 % fällig am 01.06.2029		1.000	784	0,04
Diamond BC BV				
4,625 % fällig am 01.10.2029		8.000	8.075	0,41
Diamond Foreign Asset Co. (9,000 % bar oder 9,000 % PIK)				
9,000 % fällig am 22.04.2027 (b)(i)		115	111	0,01
9,000 % fällig am 22.04.2027 (b)		31	30	0,00
Diamond Offshore Drilling, Inc.				
13,000 % fällig am 21.12.2026		77	75	0,00
Diamond Sports Group LLC				
5,375 % fällig am 15.08.2026 ^		8.000	275	0,01
Directv Financing LLC				
5,875 % fällig am 15.08.2027		10.000	9.068	0,46
DISH DBS Corp.				
5,250 % fällig am 01.12.2026		5.000	4.020	0,20
5,750 % fällig am 01.12.2028		4.000	2.983	0,15
5,875 % fällig am 15.11.2024		5.000	4.379	0,22
7,750 % fällig am 01.07.2026		3.000	1.843	0,09
DISH Network Corp.				
11,750 % fällig am 15.11.2027		2.500	2.443	0,12
DT Midstream, Inc.				
4,125 % fällig am 15.06.2029		4.000	3.514	0,18
4,375 % fällig am 15.06.2031		2.500	2.157	0,11
Element Solutions, Inc.				
3,875 % fällig am 01.09.2028		3.000	2.620	0,13
Emerald Debt Merger Sub LLC				
6,625 % fällig am 15.12.2030		3.800	3.772	0,19
Encino Acquisition Partners Holdings LLC				
8,500 % fällig am 01.05.2028		2.184	1.984	0,10
Endo DAC				
6,000 % fällig am 30.06.2028 ^		8.000	420	0,02
Energizer Holdings, Inc.				
4,750 % fällig am 15.06.2028		1.100	982	0,05
EnLink Midstream LLC				
5,625 % fällig am 15.01.2028		5.000	4.843	0,25
6,500 % fällig am 01.09.2030		2.500	2.500	0,13
EnLink Midstream Partners LP				
4,150 % fällig am 01.06.2025		1.987	1.929	0,10
EQM Midstream Partners LP				
4,000 % fällig am 01.08.2024		1.123	1.100	0,06
4,500 % fällig am 15.01.2029		7.700	6.876	0,35
4,750 % fällig am 15.01.2031		4.450	3.903	0,20
6,000 % fällig am 01.07.2025		735	728	0,04
6,500 % fällig am 01.07.2027		2.000	1.975	0,10
6,500 % fällig am 15.07.2048		3.800	3.442	0,17
Fertitta Entertainment LLC				
4,625 % fällig am 15.01.2029		2.000	1.757	0,09
6,750 % fällig am 15.01.2030		7.000	5.964	0,30
First Student Bidco, Inc.				
4,000 % fällig am 31.07.2029		3.000	2.545	0,13
Ford Motor Co.				
3,250 % fällig am 12.02.2032		4.000	3.150	0,16
6,100 % fällig am 19.08.2032		2.500	2.425	0,12
Fortrea Holdings, Inc.				
7,500 % fällig am 01.07.2030		2.500	2.563	0,13
Foundation Building Materials, Inc.				
6,000 % fällig am 01.03.2029		11.000	9.199	0,47
Frontier Communications Holdings LLC				
5,000 % fällig am 01.05.2028		2.000	1.728	0,09
5,875 % fällig am 15.10.2027		2.000	1.837	0,09
6,750 % fällig am 01.05.2029		4.000	3.107	0,16
Gap, Inc.				
3,625 % fällig am 01.10.2029		3.000	2.123	0,11
3,875 % fällig am 01.10.2031		1.000	686	0,03
Garda World Security Corp.				
4,625 % fällig am 15.02.2027		1.500	1.374	0,07
6,000 % fällig am 01.06.2029		5.000	4.102	0,21
GFL Environmental, Inc.				
3,500 % fällig am 01.09.2028		5.000	4.455	0,23
4,000 % fällig am 01.08.2028		5.000	4.477	0,23
5,125 % fällig am 15.12.2026		1.000	966	0,05
Go Daddy Operating Co. LLC				
3,500 % fällig am 01.03.2029	$	5.000	$ 4.289	0,22
Golden Entertainment, Inc.				
7,625 % fällig am 15.04.2026		2.500	2.514	0,13
Graham Packaging Co., Inc.				
7,125 % fällig am 15.08.2028		6.700	5.729	0,29
Graphic Packaging International LLC				
3,500 % fällig am 01.03.2029		5.000	4.379	0,22
Grifols Escrow Issuer S.A.				
4,750 % fällig am 15.10.2028		8.700	7.560	0,38
H-Food Holdings LLC				
8,500 % fällig am 01.06.2026		2.500	991	0,05
Herens Holdco SARL				
4,750 % fällig am 15.05.2028		2.025	1.571	0,08
Herens Midco SARL				
5,250 % fällig am 15.05.2029	€	5.700	3.610	0,18
Hertz Corp.				
4,625 % fällig am 01.12.2026	$	2.000	1.807	0,09
5,000 % fällig am 01.12.2029		1.000	828	0,04
Hilton Domestic Operating Co., Inc.				
3,625 % fällig am 15.02.2032		5.000	4.173	0,21
3,750 % fällig am 01.05.2029		2.000	1.777	0,09
4,000 % fällig am 01.05.2031		1.000	869	0,04
5,750 % fällig am 01.05.2028		1.500	1.478	0,07
Hilton Grand Vacations Borrower Escrow LLC				
4,875 % fällig am 01.07.2031		3.000	2.520	0,13
5,000 % fällig am 01.06.2029		2.500	2.221	0,11
Howard Midstream Energy Partners LLC				
6,750 % fällig am 15.01.2027		3.000	2.860	0,14
8,875 % fällig am 15.07.2028 (a)		2.825	2.843	0,14
Howmet Aerospace, Inc.				
5,950 % fällig am 01.02.2037		2.000	2.038	0,10
iHeartCommunications, Inc.				
4,750 % fällig am 15.01.2028		5.000	3.776	0,19
6,375 % fällig am 01.05.2026		500	420	0,02
8,375 % fällig am 01.05.2027		8.750	5.841	0,30
IHO Verwaltungs GmbH (4,750 % bar oder 5,500 % PIK)				
4,750 % fällig am 15.09.2026 (b)		2.000	1.847	0,09
IHO Verwaltungs GmbH (6,000 % bar oder 6,750 % PIK)				
6,000 % fällig am 15.05.2027 (b)		2.000	1.883	0,10
IHO Verwaltungs GmbH (6,375 % bar oder 7,125 % PIK)				
6,375 % fällig am 15.05.2029 (b)		1.750	1.625	0,08
Imola Merger Corp.				
4,750 % fällig am 15.05.2029		5.000	4.354	0,22
Ingevity Corp.				
3,875 % fällig am 01.11.2028		5.000	4.273	0,22
Innophos Holdings, Inc.				
9,375 % fällig am 15.02.2028		8.000	7.944	0,40
Intelligent Packaging Holdco Issuer LP (9,000 % bar oder 9,750 % PIK)				
9,000 % fällig am 15.01.2026 (b)		3.000	2.285	0,12
Intelligent Packaging Ltd. Finco, Inc.				
6,000 % fällig am 15.09.2028		4.000	3.404	0,17
Intelsat Jackson Holdings S.A.				
6,500 % fällig am 15.03.2030		11.249	10.269	0,52
IQVIA, Inc.				
5,000 % fällig am 15.10.2026		5.000	4.832	0,24
Iris Holdings, Inc. (8,750 % bar oder 9,500 % PIK)				
8,750 % fällig am 15.02.2026 (b)		3.750	3.573	0,18
Jeld-Wen, Inc.				
4,625 % fällig am 15.12.2025		1.500	1.455	0,07
4,875 % fällig am 15.12.2027		1.000	887	0,05
LABL, Inc.				
5,875 % fällig am 01.11.2028		2.125	1.937	0,10
6,750 % fällig am 15.07.2026		2.000	1.969	0,10
8,250 % fällig am 01.11.2029		3.000	2.514	0,13
10,500 % fällig am 15.07.2027		3.250	3.124	0,16
Lamb Weston Holdings, Inc.				
4,125 % fällig am 31.01.2030		2.000	1.789	0,09
4,875 % fällig am 15.05.2028		2.000	1.917	0,10
LBM Acquisition LLC				
6,250 % fällig am 15.01.2029		1.275	1.057	0,05
Legacy LifePoint Health LLC				
4,375 % fällig am 15.02.2027		4.000	3.100	0,16
Level 3 Financing, Inc.				
3,750 % fällig am 15.07.2029		5.000	3.017	0,15

BESCHREIBUNG		PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
LifePoint Health, Inc.				
5,375 % fällig am 15.01.2029	$	5.000	$ 2.958	0,15
Lindblad Expeditions LLC				
6,750 % fällig am 15.02.2027		1.900	1.812	0,09
Madison IAQ LLC				
4,125 % fällig am 30.06.2028		3.000	2.644	0,13
5,875 % fällig am 30.06.2029		2.250	1.825	0,09
MajorDrive Holdings LLC				
6,375 % fällig am 01.06.2029		7.800	6.202	0,31
Marriott Ownership Resorts, Inc.				
4,500 % fällig am 15.06.2029		3.250	2.808	0,14
Mattel, Inc.				
3,375 % fällig am 01.04.2026		3.000	2.764	0,14
3,750 % fällig am 01.04.2029		2.000	1.762	0,09
5,875 % fällig am 15.12.2027		4.000	3.932	0,20
Mauser Packaging Solutions Holding Co.				
7,875 % fällig am 15.08.2026		3.500	3.481	0,18
9,250 % fällig am 15.04.2027		4.000	3.697	0,19
McAfee Corp.				
7,375 % fällig am 15.02.2030		9.000	7.835	0,40
Medline Borrower LP				
3,875 % fällig am 01.04.2029		7.000	6.090	0,31
5,250 % fällig am 01.10.2029		18.000	15.637	0,79
Merlin Entertainments Ltd.				
5,750 % fällig am 15.06.2026		2.000	1.930	0,10
Michaels Cos., Inc.				
5,250 % fällig am 01.05.2028		3.000	2.427	0,12
Midwest Gaming Borrower LLC				
4,875 % fällig am 01.05.2029		5.000	4.420	0,22
Monitchem HoldCo 3 S.A.				
8,750 % fällig am 01.05.2028	€	800	864	0,04
Motion Bondco DAC				
6,625 % fällig am 15.11.2027	$	1.000	916	0,05
MPH Acquisition Holdings LLC				
5,750 % fällig am 01.11.2028 (j)		5.000	3.769	0,19
Mundys SpA				
1,875 % fällig am 12.02.2028	€	7.000	6.530	0,33
Nabors Industries, Inc.				
7,375 % fällig am 15.05.2027	$	2.000	1.905	0,10
NCL Corp. Ltd.				
3,625 % fällig am 15.12.2024		5.000	4.816	0,24
5,875 % fällig am 15.03.2026		4.000	3.746	0,19
7,750 % fällig am 15.02.2029		2.500	2.377	0,12
NCR Corp.				
5,000 % fällig am 01.10.2028		1.750	1.564	0,08
5,125 % fällig am 15.04.2029		3.000	2.659	0,13
5,250 % fällig am 01.10.2030		2.000	1.742	0,09
NESCO Holdings, Inc.				
5,500 % fällig am 15.04.2029		2.250	2.017	0,10
Newell Brands, Inc.				
5,875 % fällig am 01.04.2036		1.200	1.005	0,05
6,375 % fällig am 15.09.2027		1.250	1.200	0,06
Newfold Digital Holdings Group, Inc.				
6,000 % fällig am 15.02.2029		7.000	5.261	0,27
Noble Finance LLC				
8,000 % fällig am 15.04.2030		2.500	2.544	0,13
Nokia Oyj				
6,625 % fällig am 15.05.2039		3.000	2.873	0,15
Novelis Corp.				
3,250 % fällig am 15.11.2026		3.000	2.719	0,14
3,875 % fällig am 15.08.2031		7.000	5.768	0,29
4,750 % fällig am 30.01.2030		5.000	4.448	0,23
NuStar Logistics LP				
5,750 % fällig am 01.10.2025		2.000	1.952	0,10
6,375 % fällig am 01.10.2030		2.000	1.910	0,10
Olympus Water U.S. Holding Corp.				
3,875 % fällig am 01.10.2028	€	1.000	864	0,04
4,250 % fällig am 01.10.2028	$	7.000	5.540	0,28
5,375 % fällig am 01.10.2029 (j)	€	8.000	6.115	0,31
6,250 % fällig am 01.10.2029	$	2.000	1.448	0,07
ON Semiconductor Corp.				
3,875 % fällig am 01.09.2028		2.500	2.278	0,12
Organon & Co.				
4,125 % fällig am 30.04.2028		5.000	4.443	0,22
5,125 % fällig am 30.04.2031		4.000	3.305	0,17
Outfront Media Capital LLC				
4,250 % fällig am 15.01.2029		2.000	1.683	0,09
5,000 % fällig am 15.08.2027	$	2.125	$ 1.932	0,10
Owens-Brockway Glass Container, Inc.				
7,250 % fällig am 15.05.2031		3.000	3.041	0,15
Pactiv Evergreen Group Issuer LLC				
4,375 % fällig am 15.10.2028		3.000	2.601	0,13
Pactiv Evergreen Group Issuer, Inc.				
4,000 % fällig am 15.10.2027		5.000	4.427	0,22
Performance Food Group, Inc.				
4,250 % fällig am 01.08.2029		3.000	2.674	0,14
5,500 % fällig am 15.10.2027		1.500	1.447	0,07
6,875 % fällig am 01.05.2025		1.000	1.002	0,05
Permian Resources Operating LLC				
5,375 % fällig am 15.01.2026		5.000	4.768	0,24
PetSmart, Inc.				
4,750 % fällig am 15.02.2028		8.500	7.865	0,40
7,750 % fällig am 15.02.2029		5.000	4.974	0,25
Post Holdings, Inc.				
4,500 % fällig am 15.09.2031		1.779	1.521	0,08
4,625 % fällig am 15.04.2030		5.000	4.387	0,22
5,625 % fällig am 15.01.2028		4.000	3.849	0,19
Presidio Holdings, Inc.				
4,875 % fällig am 01.02.2027		2.500	2.349	0,12
8,250 % fällig am 01.02.2028		3.750	3.575	0,18
Prime Security Services Borrower LLC				
3,375 % fällig am 31.08.2027		2.000	1.766	0,09
5,250 % fällig am 15.04.2024		1.600	1.588	0,08
5,750 % fällig am 15.04.2026		1.000	983	0,05
6,250 % fällig am 15.01.2028		5.000	4.691	0,24
Radiate Holdco LLC				
4,500 % fällig am 15.09.2026		7.000	5.590	0,28
6,500 % fällig am 15.09.2028		4.000	2.340	0,12
Real Hero Merger Sub, Inc.				
6,250 % fällig am 01.02.2029		2.500	2.053	0,10
Ritchie Bros Holdings, Inc.				
6,750 % fällig am 15.03.2028		1.250	1.261	0,06
7,750 % fällig am 15.03.2031		2.000	2.077	0,11
Rockcliff Energy LLC				
5,500 % fällig am 15.10.2029		6.000	5.541	0,28
Rockies Express Pipeline LLC				
4,800 % fällig am 15.05.2030		2.000	1.750	0,09
4,950 % fällig am 15.07.2029		2.000	1.832	0,09
Roller Bearing Co. of America, Inc.				
4,375 % fällig am 15.10.2029		3.000	2.691	0,14
Rolls-Royce PLC				
3,625 % fällig am 14.10.2025		1.000	950	0,05
5,750 % fällig am 15.10.2027	£	1.750	2.068	0,10
Royal Caribbean Cruises Ltd.				
4,250 % fällig am 01.07.2026	$	5.000	4.594	0,23
5,375 % fällig am 15.07.2027		3.000	2.808	0,14
5,500 % fällig am 31.08.2026		10.000	9.490	0,48
5,500 % fällig am 01.04.2028		7.100	6.628	0,34
7,250 % fällig am 15.01.2030		2.000	2.027	0,10
Sabre GLBL, Inc.				
7,375 % fällig am 01.09.2025		1.000	889	0,05
9,250 % fällig am 15.04.2025		183	171	0,01
Scientific Games Holdings LP				
6,625 % fällig am 01.03.2030		7.000	6.166	0,31
SCIH Salt Holdings, Inc.				
4,875 % fällig am 01.05.2028		5.000	4.472	0,23
6,625 % fällig am 01.05.2029		5.000	4.195	0,21
Scripps Escrow, Inc.				
5,375 % fällig am 15.01.2031 (j)		5.000	3.528	0,18
Seagate HDD Cayman				
8,250 % fällig am 15.12.2029		1.150	1.202	0,06
8,500 % fällig am 15.07.2031		1.175	1.234	0,06
9,625 % fällig am 01.12.2032		2.000	2.209	0,11
Sensata Technologies BV				
4,000 % fällig am 15.04.2029		5.000	4.456	0,23
Sensata Technologies, Inc.				
3,750 % fällig am 15.02.2031		4.000	3.426	0,17
Sigma Holdco BV				
7,875 % fällig am 15.05.2026		8.000	6.885	0,35
Simmons Foods, Inc.				
4,625 % fällig am 01.03.2029		5.000	4.012	0,20
Sirius XM Radio, Inc.				
3,875 % fällig am 01.09.2031		1.000	774	0,04
4,125 % fällig am 01.07.2030		3.250	2.657	0,13
5,000 % fällig am 01.08.2027	$	1.000	$ 929	0,05
SM Energy Co.				
6,500 % fällig am 15.07.2028		1.500	1.441	0,07
Southwestern Energy Co.				
4,750 % fällig am 01.02.2032		1.000	883	0,04
5,375 % fällig am 01.02.2029		3.000	2.828	0,14
5,375 % fällig am 15.03.2030		3.000	2.802	0,14
Spectrum Brands, Inc.				
3,875 % fällig am 15.03.2031		4.000	3.284	0,17
5,500 % fällig am 15.07.2030		3.000	2.740	0,14
5,750 % fällig am 15.07.2025		2.000	2.000	0,10
Spirit AeroSystems, Inc.				
4,600 % fällig am 15.06.2028		6.275	5.271	0,27
7,500 % fällig am 15.04.2025		3.250	3.216	0,16
9,375 % fällig am 30.11.2029		3.000	3.215	0,16
Spirit Loyalty Cayman Ltd.				
8,000 % fällig am 20.09.2025		3.000	3.025	0,15
SRS Distribution, Inc.				
6,000 % fällig am 01.12.2029		4.300	3.717	0,19
6,125 % fällig am 01.07.2029		4.300	3.719	0,19
Standard Industries, Inc.				
3,375 % fällig am 15.01.2031		4.000	3.225	0,16
4,375 % fällig am 15.07.2030		2.500	2.168	0,11
4,750 % fällig am 15.01.2028		3.500	3.263	0,17
5,000 % fällig am 15.02.2027		1.500	1.431	0,07
Station Casinos LLC				
4,500 % fällig am 15.02.2028		2.000	1.798	0,09
4,625 % fällig am 01.12.2031		1.000	844	0,04
Strathcona Resources Ltd.				
6,875 % fällig am 01.08.2026		4.625	4.053	0,21
Sugarhouse HSP Gaming Prop Mezz LP				
5,875 % fällig am 15.05.2025		3.150	3.043	0,15
Summer BC Bidco LLC				
5,500 % fällig am 31.10.2026		4.000	3.371	0,17
Superior Plus LP				
4,500 % fällig am 15.03.2029		3.000	2.633	0,13
Syneos Health, Inc.				
3,625 % fällig am 15.01.2029		3.000	2.936	0,15
Team Health Holdings, Inc.				
6,375 % fällig am 01.02.2025		10.300	5.478	0,28
TEGNA, Inc.				
4,625 % fällig am 15.03.2028		1.000	886	0,05
4,750 % fällig am 15.03.2026		1.000	956	0,05
5,000 % fällig am 15.09.2029		4.000	3.455	0,17
Tenet Healthcare Corp.				
4,375 % fällig am 15.01.2030		4.000	3.613	0,18
5,125 % fällig am 01.11.2027		3.500	3.345	0,17
6,125 % fällig am 01.10.2028		10.000	9.637	0,49
6,125 % fällig am 15.06.2030		5.000	4.935	0,25
6,875 % fällig am 15.11.2031		4.000	3.996	0,20
TK Elevator Holdco GmbH				
6,625 % fällig am 15.07.2028	€	1.800	1.686	0,09
7,625 % fällig am 15.07.2028	$	4.734	4.300	0,22
TK Elevator U.S. Newco, Inc.				
5,250 % fällig am 15.07.2027		3.500	3.238	0,16
TransDigm, Inc.				
4,625 % fällig am 15.01.2029		7.000	6.235	0,32
5,500 % fällig am 15.11.2027		7.000	6.611	0,33
6,250 % fällig am 15.03.2026		1.750	1.743	0,09
6,750 % fällig am 15.08.2028		5.000	5.025	0,25
Transocean Titan Financing Ltd.				
8,375 % fällig am 01.02.2028		4.000	4.089	0,21
Transocean, Inc.				
8,750 % fällig am 15.02.2030		2.000	2.032	0,10
Travel + Leisure Co.				
4,625 % fällig am 01.03.2030		5.000	4.236	0,21
6,625 % fällig am 31.07.2026		3.500	3.477	0,18
Trident TPI Holdings, Inc.				
12,750 % fällig am 31.12.2028		9.750	10.123	0,51
TriNet Group, Inc.				
3,500 % fällig am 01.03.2029		5.000	4.352	0,22
Triton Water Holdings, Inc.				
6,250 % fällig am 01.04.2029		2.000	1.719	0,09
Triumph Group, Inc.				
7,750 % fällig am 15.08.2025		4.000	3.893	0,20
9,000 % fällig am 15.03.2028		5.250	5.367	0,27

BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
Twilio, Inc.			
3,625 % fällig am 15.03.2029	$ 3.000	$ 2.555	0,13
3,875 % fällig am 15.03.2031	2.500	2.084	0,11
U.S. Acute Care Solutions LLC			
6,375 % fällig am 01.03.2026	6.000	5.144	0,26
U.S. Foods, Inc.			
4,750 % fällig am 15.02.2029	7.000	6.416	0,32
6,250 % fällig am 15.04.2025	2.000	2.001	0,10
U.S. Renal Care, Inc.			
10,625 % fällig am 15.07.2027	6.000	1.530	0,08
Uber Technologies, Inc.			
4,500 % fällig am 15.08.2029	4.000	3.689	0,19
7,500 % fällig am 15.09.2027	1.500	1.536	0,08
United Airlines, Inc.			
4,375 % fällig am 15.04.2026	4.000	3.804	0,19
4,625 % fällig am 15.04.2029	8.900	8.117	0,41
Univar Solutions USA, Inc.			
5,125 % fällig am 01.12.2027	2.500	2.558	0,13
Univision Communications, Inc.			
4,500 % fällig am 01.05.2029	7.000	6.022	0,30
6,625 % fällig am 01.06.2027	2.000	1.936	0,10
UPC Holding BV			
5,500 % fällig am 15.01.2028	3.000	2.623	0,13
Valaris Ltd.			
8,375 % fällig am 30.04.2030	2.700	2.712	0,14
Venture Global Calcasieu Pass LLC			
3,875 % fällig am 15.08.2029	5.000	4.373	0,22
4,125 % fällig am 15.08.2031	3.000	2.584	0,13
Venture Global LNG, Inc.			
8,125 % fällig am 01.06.2028	6.000	6.101	0,31
8,375 % fällig am 01.06.2031	10.100	10.196	0,52
Vertiv Group Corp.			
4,125 % fällig am 15.11.2028	7.000	6.313	0,32
ViaSat, Inc.			
5,625 % fällig am 15.09.2025	2.500	2.425	0,12
6,500 % fällig am 15.07.2028	2.000	1.697	0,09
Viking Cruises Ltd.			
5,875 % fällig am 15.09.2027	5.000	4.601	0,23
7,000 % fällig am 15.02.2029	4.000	3.724	0,19
9,125 % fällig am 15.07.2031	3.000	3.033	0,15
Virgin Media Secured Finance PLC			
4,500 % fällig am 15.08.2030	5.000	4.196	0,21
5,500 % fällig am 15.05.2029	4.000	3.622	0,18
Vmed O2 UK Financing PLC			
4,250 % fällig am 31.01.2031	5.000	4.047	0,20
VOC Escrow Ltd.			
5,000 % fällig am 15.02.2028	2.000	1.837	0,09
WESCO Distribution, Inc.			
7,125 % fällig am 15.06.2025	3.000	3.034	0,15
7,250 % fällig am 15.06.2028	4.000	4.084	0,21
White Cap Buyer LLC			
6,875 % fällig am 15.10.2028	7.200	6.535	0,33
White Cap Parent LLC (8,250 % bar oder 9,000 % PIK)			
8,250 % fällig am 15.03.2026 (b)	5.250	5.035	0,25
Williams Scotsman International, Inc.			
4,625 % fällig am 15.08.2028	2.750	2.517	0,13
6,125 % fällig am 15.06.2025	1.000	994	0,05
WMG Acquisition Corp.			
3,000 % fällig am 15.02.2031	3.250	2.632	0,13
3,875 % fällig am 15.07.2030	3.000	2.591	0,13
WR Grace Holdings LLC			
4,875 % fällig am 15.06.2027	3.000	2.786	0,14
5,625 % fällig am 15.08.2029	3.000	2.461	0,12
WW International, Inc.			
4,500 % fällig am 15.04.2029	2.000	1.184	0,06
Wyndham Hotels & Resorts, Inc.			
4,375 % fällig am 15.08.2028	3.000	2.742	0,14
Wynn Las Vegas LLC			
5,250 % fällig am 15.05.2027	3.000	2.845	0,14
5,500 % fällig am 01.03.2025	3.000	2.955	0,15
Wynn Macau Ltd.			
5,500 % fällig am 01.10.2027	2.000	1.782	0,09
Wynn Resorts Finance LLC			
5,125 % fällig am 01.10.2029	3.000	2.692	0,14
XPO, Inc.			
7,125 % fällig am 01.06.2031	2.000	2.018	0,10
Yum! Brands, Inc.			
3,625 % fällig am 15.03.2031	2.000	1.730	0,09

BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
4,625 % fällig am 31.01.2032	$ 5.000	$ 4.523	0,23
4,750 % fällig am 15.01.2030	2.000	1.875	0,10
6,875 % fällig am 15.11.2037	2.000	2.161	0,11
Zayo Group Holdings, Inc.			
4,000 % fällig am 01.03.2027	3.000	2.122	0,11
ZF North America Capital, Inc.			
6,875 % fällig am 14.04.2028	550	558	0,03
7,125 % fällig am 14.04.2030	1.450	1.476	0,07
Ziggo BV			
4,875 % fällig am 15.01.2030	4.200	3.490	0,18
		1.387.008	70,14
VERSORGUNGSUNTERNEHMEN			
Antero Midstream Partners LP			
5,375 % fällig am 15.06.2029	2.500	2.325	0,12
5,750 % fällig am 01.03.2027	1.000	965	0,05
Blue Racer Midstream LLC			
6,625 % fällig am 15.07.2026	2.000	1.982	0,10
7,625 % fällig am 15.12.2025	2.000	2.024	0,10
Calpine Corp.			
3,750 % fällig am 01.03.2031	5.000	4.055	0,21
4,500 % fällig am 15.02.2028	2.500	2.266	0,11
5,125 % fällig am 15.03.2028	2.000	1.788	0,09
Clearway Energy Operating LLC			
3,750 % fällig am 15.02.2031	10.000	8.308	0,42
Crestwood Midstream Partners LP			
5,625 % fällig am 01.05.2027	3.000	2.847	0,14
6,000 % fällig am 01.02.2029	2.000	1.870	0,09
CrownRock LP			
5,000 % fällig am 01.05.2029	2.000	1.876	0,09
5,625 % fällig am 15.10.2025	3.000	2.959	0,15
Endeavor Energy Resources LP			
5,750 % fällig am 30.01.2028	5.000	4.895	0,25
Genesis Energy LP			
6,500 % fällig am 01.10.2025	2.000	1.972	0,10
7,750 % fällig am 01.02.2028	1.000	952	0,05
8,000 % fällig am 15.01.2027	2.000	1.952	0,10
High Ridge Brands Co.			
8,875 % fällig am 15.03.2025	2.500	41	0,00
Lumen Technologies, Inc.			
4,500 % fällig am 15.01.2029	3.000	1.443	0,07
NGL Energy Operating LLC			
7,500 % fällig am 01.02.2026	4.575	4.511	0,23
NRG Energy, Inc.			
3,375 % fällig am 15.02.2029	2.000	1.638	0,08
5,250 % fällig am 15.06.2029	1.250	1.119	0,06
6,625 % fällig am 15.01.2027	838	833	0,04
NSG Holdings LLC			
7,750 % fällig am 15.12.2025	500	498	0,03
Tallgrass Energy Partners LP			
5,500 % fällig am 15.01.2028	1.750	1.602	0,08
6,000 % fällig am 31.12.2030	2.000	1.764	0,09
7,500 % fällig am 01.10.2025	1.000	999	0,05
Telecom Italia Capital S.A.			
6,375 % fällig am 15.11.2033	2.500	2.123	0,11
7,200 % fällig am 18.07.2036	1.500	1.291	0,07
TerraForm Power Operating LLC			
4,750 % fällig am 15.01.2030	2.000	1.767	0,09
5,000 % fällig am 31.01.2028	2.000	1.843	0,09
		64.508	3,26
Summe Unternehmensanleihen und Wechsel		1.588.798	80,34
US-SCHATZOBLIGATIONEN			
U.S. Treasury Notes			
3,125 % fällig am 31.08.2027	25.000	23.914	1,21
3,500 % fällig am 15.09.2025	40.000	38.926	1,97
3,500 % fällig am 31.01.2028	25.000	24.280	1,23
3,875 % fällig am 30.11.2027	35.000	34.510	1,74
3,875 % fällig am 31.12.2027	10.000	9.861	0,50
4,125 % fällig am 30.09.2027	25.000	24.865	1,26
4,250 % fällig am 15.10.2025	50.000	49.449	2,50
		205.805	10,41
NON-AGENCY-MBS			
Banc of America Funding Trust			
4,123 % fällig am 20.02.2036 ^	69	63	0,00

BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
Countrywide Alternative Loan Trust			
5,617 % fällig am 20.05.2046 ^	$ 55	$ 46	0,00
Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust			
5,790 % fällig am 25.03.2035	16	13	0,00
5,850 % fällig am 25.02.2036 ^	3	1	0,00
Credit Suisse Mortgage Capital Mortgage-Backed Trust			
5,863 % fällig am 25.02.2037 ^	344	82	0,01
Deutsche ALT-A Securities, Inc. Mortgage Loan Trust			
5,500 % fällig am 25.12.2035 ^	39	32	0,00
GSR Mortgage Loan Trust			
4,567 % fällig am 25.04.2035	1	1	0,00
IndyMac Mortgage Loan Trust			
6,000 % fällig am 25.07.2037 ^	188	138	0,01
MortgageIT Trust			
5,790 % fällig am 25.02.2035	29	28	0,00
Residential Accredit Loans, Inc. Trust			
5,690 % fällig am 25.05.2046 ^	80	64	0,00
TBW Mortgage-Backed Trust			
6,470 % fällig am 25.09.2036 ^	662	20	0,00
WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust			
3,528 % fällig am 25.12.2036 ^	160	140	0,01
3,816 % fällig am 25.10.2036 ^	90	82	0,01
		710	0,04
FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE			
Credit-Based Asset Servicing & Securitization Trust			
2,959 % fällig am 25.01.2037 ^	77	24	0,00
	AKTIEN		
STAMMAKTIEN			
KOMMUNIKATIONSDIENSTE			
Clear Channel Outdoor Holdings, Inc. (c)	167.378	229	0,01
iHeartMedia, Inc. 'A' (c)	38.621	141	0,01
iHeartMedia, Inc. 'B' (c)	29.972	98	0,00
Intelsat Emergence S.A. (c)(i)	152.075	3.498	0,18
		3.966	0,20
ENERGIE			
CHC Group LLC (c)	3.887	0	0,00
FINANZWERTE			
DB Investors, Inc. (c)(i)	30	0	0,00
Voyager Aviation Holdings LLC (c)	833	0	0,00
		0	0,00
		3.966	0,20
RECHTE			
Intelsat Jackson Holdings S.A. - Exp. 05.12.2025	31.850	191	0,01
OPTIONSSCHEINE			
DB Investors, Inc. - Exp. 28.06.2069 (i)	113	0	0,00
Revlon Group Holdings LLC - 28.04.2028	30.870	93	0,00
		93	0,00
VORZUGSWERTPAPIERE			
Voyager Aviation Holdings LLC 9,500 %	5.000	1.205	0,06
	PAR (000S)		
KURZFRISTIGE INSTRUMENTE			
U.S. TREASURY BILLS			
5,150 % fällig am 03.08.2023 (d)(e)	$ 54.900	54.658	2,76
Summe kurzfristige Instrumente		54.658	2,76
Summe Übertragbare Wertpapiere		**$ 1.868.312**	**94,47**

BESCHREIBUNG	AKTIEN	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
INVESTMENTFONDS			
ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN			
PIMCO Funds: Global Investors Series plc - PIMCO Asia High Yield Bond Fund (g)	661.211	$ 6.011	0,30
PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (g)	6.209.417	61.833	3,13
		67.844	3,43
Summe Investmentfonds		**$ 67.844**	**3,43**

PENSIONSGESCHÄFTE

Kontrahent	Kredit-zins	Abrechnungs-datum	Fälligkeits-datum	Kapital-betrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensions-geschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensions-geschäft[1]	% des Nettovermögens
FICC	2,400 %	30.06.2023	03.07.2023	$ 10.034	U.S. Treasury Notes 4,625 % fällig am 30.06.2025	$ (10.235)	$ 10.034	$ 10.034	0,51
Summe Pensionsgeschäfte						**$ (10.235)**	**$ 10.034**	**$ 10.034**	**0,51**

(1) Umfasst aufgelaufene Zinsen.

ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)

*** Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt**

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMMISSIONEN - SCHUTZVERKAUF[1]

Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag[2]	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Newell Brands, Inc.	1,000 %	20.06.2028	$ 2.275	$ 20	0,00

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES - SCHUTZVERKAUF[1]

Index/Tranchen	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag[2]	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
CDX.HY-40 5-Year Index	5,000 %	20.06.2028	$ 168.200	$ 2.781	0,14
Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate				**$ 2.801**	**0,14**

(1) Agiert der Fonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Fonds entweder (i) dem Sicherungsnehmer einen Betrag, der dem Nennwert des Swaps entspricht, und erhält die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er zahlt einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.

(2) Der maximal mögliche Betrag, den der Fonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

DERIVATIVE OTC-FINANZINSTRUMENTE (Beträge in Tausend*, außer Anzahl der Kontrakte)

*** Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt**

DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BPS	07.2023	$ 42.372	€ 38.671	$ 0	$ (182)	$ (182)	(0,01)
	08.2023	€ 38.671	$ 42.431	184	0	184	0,01
CBK	08.2023	CAD 872	654	0	(5)	(5)	0,00
JPM	08.2023	1.433	1.072	0	(12)	(12)	0,00
MBC	07.2023	£ 3.451	4.272	0	(116)	(116)	(0,01)
MYI	07.2023	€ 70	77	0	0	0	0,00
	07.2023	$ 560	€ 514	1	0	1	0,00
	07.2023	40	£ 32	0	0	0	0,00
SOG	07.2023	€ 38.671	$ 41.600	0	(590)	(590)	(0,03)
TOR	07.2023	$ 4.385	£ 3.451	2	0	2	0,00
	08.2023	£ 3.451	$ 4.386	0	(2)	(2)	0,00
				$ 187	$ (907)	$ (720)	(0,04)

ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 30. Juni 2023 standen für die Institutional EUR (Hedged) thesaurierend, Institutional EUR (Hedged) ausschüttend, Investor EUR (Hedged) thesaurierend und Class E EUR (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Wertzunahme (Wertabnahme)	% des Nettovermögen
BOA	07.2023	€ 1.865	$ 2.038	$ 3	$ 0	$ 3	0,00
	07.2023	$ 116.442	€ 108.348	1.765	0	1.765	0,09
BPS	07.2023	€ 108.799	$ 119.208	509	(1)	508	0,03
	07.2023	$ 116.330	€ 108.209	1.729	(2)	1.727	0,09
	08.2023	118.571	108.063	0	(512)	(512)	(0,03)
CBK	07.2023	€ 110.393	$ 119.976	0	(463)	(463)	(0,02)
	08.2023	$ 116.082	€ 106.621	401	0	401	0,02
JPM	07.2023	€ 108.288	$ 118.240	97	0	97	0,00
	07.2023	$ 5.288	€ 4.945	108	0	108	0,01
	08.2023	118.405	108.288	0	(101)	(101)	(0,01)
MBC	07.2023	€ 749	$ 803	0	(15)	(15)	0,00
	07.2023	$ 44	€ 41	1	0	1	0,00
SOG	07.2023	116.237	108.053	1.649	0	1.649	0,08
				$ 6.262	$ (1.094)	$ 5.168	0,26

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklassen Institutional GBP (Hedged) thesaurierend und Institutional GBP (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2023	£ 20	$ 25	$ 0	$ 0	$ 0	0,00
	07.2023	$ 15	£ 12	0	0	0	0,00
BPS	07.2023	£ 26	$ 32	0	(1)	(1)	0,00
	07.2023	$ 19.820	£ 15.999	526	(7)	519	0,03
BRC	07.2023	307	248	8	0	8	0,00
CBK	07.2023	£ 52	$ 66	0	0	0	0,00
JPM	07.2023	15.673	19.818	0	(109)	(109)	(0,01)
	08.2023	$ 19.822	£ 15.673	109	0	109	0,01
MBC	07.2023	18.966	15.320	511	0	511	0,03
MYI	07.2023	18.858	15.173	432	0	432	0,02
TOR	07.2023	£ 15.694	$ 19.942	0	(10)	(10)	0,00
	08.2023	$ 19.947	£ 15.694	10	0	10	0,00
				$ 1.596	$ (127)	$ 1.469	0,08

Summe Freiverkehrsfinanzderivate	**$ 5.917**	**0,30**
Summe Anlagen	**$ 1.954.908**	**98,85**
Sonstige Aktiva und Passiva	**$ 22.693**	**1,15**
Nettovermögen	**$ 1.977.601**	**100,00**

ERLÄUTERUNGEN ZUR AUFSTELLUNG DES WERTPAPIERBESTANDS (Angaben in Tausend*):

***** **Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt**

^ **Das Wertpapier ist in Verzug.**

(a) **Wertpapier per Emissionstermin.**

(b) **Wertpapier mit Sachwertausschüttung.**

(c) **Das Wertpapier hat in den letzten zwölf Monaten keine Erträge geliefert.**

(d) **Nullkuponwertpapier.**

(e) **Der Kupon stellt eine Rendite bis zur Endfälligkeit dar.**

(f) **Unbegrenzte Laufzeit; das gegebenenfalls angegebene Datum stellt den nächsten vertraglichen Kündigungstermin dar.**

(g) **Mit dem Fonds verbunden.**

(h) **Bedingt wandelbares Wertpapier.**

(i) **Eingeschränkte Wertpapiere (31. Dezember 2022: 0,39 %):**

Emittentenbeschreibung	Kauf-datum	Kosten	Markt-wert	% des Nettovermögen
DB Investors, Inc.	18.02.2015	$ 0	$ 0	0,00
DB Investors, Inc. - Exp. 28.06.2069	18.02.2015	0	0	0,00
Diamond Foreign Asset Co, (9,000 % Cash or 9,000 % PIK) 9,000 % fällig am 22.04.2027	12.05.2021	115	111	0,01
Intelsat Emergence S.A.	11.02.2014 - 02.03.2022	15.552	3.498	0,18
		$ 15.667	$ 3.609	0,19

(j) Wertpapiere mit einem gesamten beizulegenden Zeitwert von 11.276 USD (31. Dezember 2022: null USD) wurde zum 30. Juni 2023 gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte als Sicherheit verpfändet.

Wertpapiere mit einem gesamten beizulegenden Zeitwert von 503 USD (31. Dezember 2022: null USD) wurden zum 30. Juni 2023 gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte als Sicherheit geliefert.

Barmittel in Höhe von 17.435 USD (31. Dezember 2022: 10.449 USD) wurden zum 30. Juni 2023 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Beizulegender Zeitwert[1]

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 30. Juni 2023 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie[2]	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	$ 370	$ 1.862.780	$ 5.162	$ 1.868.312
Investmentfonds	67.844	0	0	67.844
Pensionsgeschäfte	0	10.034	0	10.034
Finanzderivate[3]	0	8.718	0	8.718
Summen	**$ 68.214**	**$ 1.881.532**	**$ 5.162**	**$ 1.954.908**

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 31. Dezember 2022 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie[2]	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	$ 413	$ 1.889.527	$ 5.525	$ 1.895.465
Investmentfonds	39.162	0	0	39.162
Pensionsgeschäfte	0	9.269	0	9.269
Finanzderivate[3]	0	11.167	0	11.167
Summen	**$ 39.575**	**$ 1.909.963**	**$ 5.525**	**$ 1.955.063**

[1] Weitere Informationen finden Sie in den Erläuterungen in Erläuterung 3.

[2] Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung des Wertpapierbestands.

[3] Finanzderivate können offene Terminkontrakte, Swap-, Verkaufs- oder Kaufoptionen sowie Devisenterminkontrakte enthalten.

Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2023:

Kontrahent	Kredit-zins	Abrechnungs-datum	Fälligkeits-datum	Kredit-betrag	Verbindlichkeiten aus umgekehrten Pensions-geschäften	% des Nettovermögens
BOS	(1,250) %	28.06.2023	07.07.2023	$ (2.784)	$ (2.784)	(0,14)
	(0,750)	28.06.2023	07.07.2023	(355)	(355)	(0,02)
BRC	(1,900)	05.05.2023	TBD [1]	(1.745)	(1.740)	(0,09)
MYI	2,500	17.05.2023	TBD [1]	€ (968)	(1.060)	(0,05)
RDR	4,000	05.05.2023	TBD [1]	$ (3.525)	(3.547)	(0,18)
Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte					**$ (9.486)**	**(0,48)**

[1] Umgekehrtes Pensionsgeschäft mit offener Laufzeit.

Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC-Finanzderivate und -Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2023 und 31. Dezember 2022:

	Zum 30. Jun. 2023			Zum 31. Dez. 2022		
Kontrahent	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-engagement[1]	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-engagement[1]
BOA	$ 1.768	$ (1.368)	$ 400	$ 9	$ 0	$ 9
BPS	2.243	(1.870)	373	k. A.	k. A.	k. A.
BRC	8	0	8	1	0	1
CBK	(67)	0	(67)	3.592	(3.540)	52
GLM	k. A.	k. A.	k. A.	2	0	2
JPM	92	0	92	(258)	0	(258)
MBC	381	(360)	21	1.402	(1.320)	82
MYI	433	(405)	28	(4)	0	(4)
RBC	k. A.	k. A.	k. A.	(1)	0	(1)
SCX	k. A.	k. A.	k. A.	3.187	(3.050)	137
SOG	1.059	(790)	269	k. A.	k. A.	k. A.
TOR	k. A.	k. A.	k. A.	11	(20)	(9)
UAG	k. A.	k. A.	k. A.	4	0	4

[1] Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären.

Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung des Wertpapierbestands zum 30. Juni 2023:

	30. Jun. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	38,68	39,23
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	55,72	56,03
Sonstige übertragbare Wertpapiere	0,07	0,24
Investmentfonds	3,43	1,97
Pensionsgeschäfte	0,51	0,47
Zentral abgerechnete Finanzderivate	0,14	0,16
Freiverkehrsfinanzderivate	0,30	0,40
Umgekehrte Pensionsgeschäfte	(0,48)	k. A.

Das Anlageportfolio des Fonds konzentriert sich zum 30. Juni 2023 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	30. Jun. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
Kreditbeteiligungen und -abtretung	0,65	0,70
Unternehmensanleihen und Wechsel	80,34	79,60
US-Schatzobligationen	10,41	11,62
Non-Agency-MBS	0,04	0,04
Forderungsbesicherte Wertpapiere	0,00	0,00
Stammaktien	0,20	0,21
Bezugsrechte	0,01	0,01
Optionsscheine	0,00	0,00
Vorzugswertpapiere	0,06	0,07
Kurzfristige Instrumente	2,76	3,25
Investmentfonds	3,43	1,97
Pensionsgeschäfte	0,51	0,47
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	0,00	k. A.
Credit Default Swaps auf Kreditindizes— Schutzverkauf	0,14	0,16
Freiverkehrsfinanzderivate		
Devisenterminkontrakte	(0,04)	(0,05)
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	0,34	0,45
Sonstige Aktiva und Passiva	1,15	1,50
Nettovermögen	100,00	100,00

BESCHREIBUNG		PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE				
KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG				
Charter Communications Operating LLC				
6,795 % - 6,834 % fällig am 01.02.2027	$	88	$ 88	0,02
Qatar National Bank QPSC				
5,966 % fällig am 10.10.2023		400	400	0,09
			488	0,11
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
BANKEN UND FINANZEN				
AerCap Ireland Capital DAC				
1,750 % fällig am 29.10.2024		3.200	3.007	0,68
4,450 % fällig am 01.10.2025		500	481	0,11
Agree LP				
4,800 % fällig am 01.10.2032		100	93	0,02
Aircastle Ltd.				
4,400 % fällig am 25.09.2023		300	298	0,07
Alexandria Real Estate Equities, Inc.				
3,950 % fällig am 15.01.2028		200	187	0,04
Ally Financial, Inc.				
6,992 % fällig am 13.06.2029		200	198	0,04
8,000 % fällig am 01.11.2031		900	934	0,21
American Homes 4 Rent LP				
4,250 % fällig am 15.02.2028		2.000	1.884	0,42
American Tower Corp.				
2,100 % fällig am 15.06.2030		200	162	0,04
2,750 % fällig am 15.01.2027		2.000	1.821	0,41
3,650 % fällig am 15.03.2027		2.300	2.156	0,48
5,650 % fällig am 15.03.2033		400	406	0,09
Antares Holdings LP				
2,750 % fällig am 15.01.2027		1.600	1.316	0,30
Ares Capital Corp.				
2,875 % fällig am 15.06.2027		800	694	0,16
Ares Finance Co. LLC				
3,250 % fällig am 15.06.2030		900	758	0,17
4,125 % fällig am 30.06.2051		200	146	0,03
Aviation Capital Group LLC				
3,500 % fällig am 01.11.2027		400	354	0,08
4,375 % fällig am 30.01.2024		100	98	0,02
4,875 % fällig am 01.10.2025		1.300	1.241	0,28
Avolon Holdings Funding Ltd.				
2,125 % fällig am 21.02.2026		400	356	0,08
2,528 % fällig am 18.11.2027		1.301	1.098	0,25
5,500 % fällig am 15.01.2026		400	388	0,09
AXIS Specialty Finance PLC				
4,000 % fällig am 06.12.2027		200	188	0,04
Banco Daycoval S.A.				
4,250 % fällig am 13.12.2024		1.200	1.168	0,26
Banco Mercantil del Norte S.A.				
6,750 % fällig am 27.09.2024 (e)(g)		500	481	0,11
Bank of America Corp.				
1,898 % fällig am 23.07.2031		3.300	2.629	0,59
2,687 % fällig am 22.04.2032		2.200	1.824	0,41
3,194 % fällig am 23.07.2030		1.800	1.588	0,36
4,300 % fällig am 28.01.2025 (e)		900	805	0,18
5,288 % fällig am 25.04.2034		3.500	3.469	0,78
Bank of Ireland Group PLC				
6,253 % fällig am 16.09.2026		700	696	0,16
Barclays PLC				
4,972 % fällig am 16.05.2029		700	662	0,15
8,000 % fällig am 15.03.2029 (e)(g)		900	806	0,18
BGC Partners, Inc.				
4,375 % fällig am 15.12.2025		1.100	1.016	0,23
Block Financial LLC				
3,875 % fällig am 15.08.2030		1.500	1.324	0,30
BNP Paribas S.A.				
7,750 % fällig am 16.08.2029 (e)(g)		700	679	0,15
Brookfield Finance, Inc.				
3,500 % fällig am 30.03.2051		400	265	0,06
3,900 % fällig am 25.01.2028		1.400	1.298	0,29
Capital One Financial Corp.				
6,312 % fällig am 08.06.2029		400	398	0,09
Carlyle Finance Subsidiary LLC				
3,500 % fällig am 19.09.2029		1.900	1.671	0,38
CBRE Services, Inc.				
5,950 % fällig am 15.08.2034		300	296	0,07
Charles Schwab Corp.				
5,643 % fällig am 19.05.2029	$	800	$ 800	0,18
Citigroup, Inc.				
2,976 % fällig am 05.11.2030		1.600	1.388	0,31
3,785 % fällig am 17.03.2033 (h)		200	177	0,04
4,075 % fällig am 23.04.2029		400	377	0,08
6,270 % fällig am 17.11.2033 (h)		2.000	2.124	0,48
Citizens Bank N.A.				
5,284 % fällig am 26.01.2026		500	464	0,10
Commonwealth Bank of Australia				
3,784 % fällig am 14.03.2032 (g)		400	336	0,08
Cooperatieve Rabobank UA				
4,655 % fällig am 22.08.2028		400	383	0,09
Corebridge Financial, Inc.				
3,850 % fällig am 05.04.2029		900	811	0,18
Corporate Office Properties LP				
2,250 % fällig am 15.03.2026		300	266	0,06
2,750 % fällig am 15.04.2031		1.400	1.065	0,24
Credit Suisse AG				
7,500 % fällig am 15.02.2028		700	744	0,17
Crown Castle, Inc.				
2,100 % fällig am 01.04.2031		500	400	0,09
3,100 % fällig am 15.11.2029		900	785	0,18
4,300 % fällig am 15.02.2029		600	565	0,13
CubeSmart LP				
3,125 % fällig am 01.09.2026		600	553	0,12
Deutsche Bank AG				
2,222 % fällig am 18.09.2024		1.000	987	0,22
EPR Properties				
4,500 % fällig am 01.06.2027		450	404	0,09
4,750 % fällig am 15.12.2026		100	91	0,02
4,950 % fällig am 15.04.2028		400	358	0,08
Equitable Holdings, Inc.				
5,594 % fällig am 11.01.2033		200	196	0,04
ERP Operating LP				
3,250 % fällig am 01.08.2027		100	92	0,02
Extra Space Storage LP				
2,350 % fällig am 15.03.2032		400	313	0,07
Fairfax Financial Holdings Ltd.				
2,750 % fällig am 29.03.2028	€	200	197	0,04
4,625 % fällig am 29.04.2030	$	1.400	1.313	0,30
4,850 % fällig am 17.04.2028		300	289	0,06
Federal Realty OP LP				
3,500 % fällig am 01.06.2030		400	349	0,08
Fifth Third Bancorp				
4,772 % fällig am 28.07.2030		800	748	0,17
Gaci First Investment Co.				
5,125 % fällig am 14.02.2053		600	541	0,12
GAIF Bond Issuer Pty. Ltd.				
3,400 % fällig am 30.09.2026		500	464	0,10
Global Atlantic Fin Co.				
3,125 % fällig am 15.06.2031		200	151	0,03
4,400 % fällig am 15.10.2029		800	675	0,15
GLP Capital LP				
3,350 % fällig am 01.09.2024		700	676	0,15
4,000 % fällig am 15.01.2031		300	260	0,06
5,750 % fällig am 01.06.2028		700	685	0,15
Goldman Sachs Group, Inc.				
2,383 % fällig am 21.07.2032		1.500	1.202	0,27
2,615 % fällig am 22.04.2032		1.000	820	0,18
3,691 % fällig am 05.06.2028		655	616	0,14
Goodman U.S. Finance Three LLC				
3,700 % fällig am 15.03.2028		1.100	998	0,22
Great-West Lifeco Finance LP				
4,581 % fällig am 17.05.2048		300	256	0,06
Hanover Insurance Group, Inc.				
4,500 % fällig am 15.04.2026		800	775	0,17
Highwoods Realty LP				
4,125 % fällig am 15.03.2028		500	438	0,10
4,200 % fällig am 15.04.2029		200	169	0,04
Host Hotels & Resorts LP				
3,500 % fällig am 15.09.2030		1.300	1.103	0,25
4,000 % fällig am 15.06.2025		1.233	1.186	0,27
HSBC Capital Funding Dollar LP				
10,176 % fällig am 30.06.2030 (e)		400	496	0,11
HSBC Holdings PLC				
2,099 % fällig am 04.06.2026		900	833	0,19
2,357 % fällig am 18.08.2031	$	1.600	$ 1.278	0,29
4,292 % fällig am 12.09.2026		1.000	962	0,22
4,583 % fällig am 19.06.2029		400	377	0,08
5,402 % fällig am 11.08.2033		900	880	0,20
6,500 % fällig am 15.09.2037		100	100	0,02
6,800 % fällig am 01.06.2038		220	222	0,05
Hudson Pacific Properties LP				
4,650 % fällig am 01.04.2029		100	71	0,02
5,950 % fällig am 15.02.2028		300	239	0,05
Invitation Homes Operating Partnership LP				
2,300 % fällig am 15.11.2028		1.300	1.107	0,25
JAB Holdings BV				
2,200 % fällig am 23.11.2030		1.600	1.260	0,28
JPMorgan Chase & Co.				
2,182 % fällig am 01.06.2028		700	623	0,14
2,545 % fällig am 08.11.2032		900	738	0,17
2,580 % fällig am 22.04.2032		5.100	4.238	0,95
3,509 % fällig am 23.01.2029		1.105	1.022	0,23
3,782 % fällig am 01.02.2028		40	38	0,01
4,000 % fällig am 01.04.2025 (e)		2.900	2.636	0,59
5,350 % fällig am 01.06.2034		400	403	0,09
Kilroy Realty LP				
3,050 % fällig am 15.02.2030		1.800	1.410	0,32
KKR Group Finance Co. LLC				
3,625 % fällig am 25.02.2050		1.100	758	0,17
Lazard Group LLC				
3,625 % fällig am 01.03.2027		100	93	0,02
4,500 % fällig am 19.09.2028		200	190	0,04
Legg Mason, Inc.				
5,625 % fällig am 15.01.2044		200	197	0,04
Life Storage LP				
3,875 % fällig am 15.12.2027		800	744	0,17
Lloyds Bank PLC				
0,000 % fällig am 02.04.2032		200	125	0,03
Mid-America Apartments LP				
1,100 % fällig am 15.09.2026		1.200	1.048	0,24
Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc.				
2,309 % fällig am 20.07.2032		2.000	1.593	0,36
5,133 % fällig am 20.07.2033		900	883	0,20
5,406 % fällig am 19.04.2034		500	496	0,11
5,441 % fällig am 22.02.2034		300	299	0,07
Mizuho Financial Group, Inc.				
3,153 % fällig am 16.07.2030		1.873	1.618	0,36
6,123 % fällig am 08.09.2024		1.600	1.601	0,36
Morgan Stanley				
4,889 % fällig am 20.07.2033		1.400	1.348	0,30
5,250 % fällig am 21.04.2034		3.600	3.557	0,80
Morgan Stanley Domestic Holdings, Inc.				
4,500 % fällig am 20.06.2028		200	193	0,04
Muthoot Finance Ltd.				
4,400 % fällig am 02.09.2023		426	423	0,09
Nasdaq, Inc.				
5,550 % fällig am 15.02.2034		400	402	0,09
NatWest Group PLC				
4,892 % fällig am 18.05.2029		1.700	1.619	0,36
Neuberger Berman Group LLC				
4,500 % fällig am 15.03.2027		1.000	944	0,21
Nissan Motor Acceptance Co. LLC				
2,750 % fällig am 09.03.2028		1.900	1.563	0,35
Nomura Holdings, Inc.				
2,679 % fällig am 16.07.2030		1.300	1.065	0,24
5,386 % fällig am 06.07.2027		2.100	2.062	0,46
Nykredit Realkredit A/S				
1,500 % fällig am 01.10.2053	DKK	9.261	1.011	0,23
Omega Healthcare Investors, Inc.				
4,750 % fällig am 15.01.2028	$	1.200	1.097	0,25
Owl Rock Capital Corp.				
2,875 % fällig am 11.06.2028		300	245	0,06
Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia				
2,800 % fällig am 23.06.2030		300	265	0,06
Physicians Realty LP				
4,300 % fällig am 15.03.2027		300	283	0,06
Sagax AB				
2,250 % fällig am 13.03.2025	€	300	309	0,07
Santander Holdings USA, Inc.				
2,490 % fällig am 06.01.2028	$	700	605	0,14
4,400 % fällig am 13.07.2027		400	376	0,08

BESCHREIBUNG		PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
6,499 % fällig am 09.03.2029	$	600	$ 594	0,13
Santander UK Group Holdings PLC				
1,532 % fällig am 21.08.2026		1.700	1.515	0,34
SBA Tower Trust				
1,884 % fällig am 15.07.2050		1.000	899	0,20
Sberbank of Russia Via SB Capital S.A.				
5,125 % fällig am 29.10.2022 ^		2.100	126	0,03
5,250 % fällig am 23.05.2023 ^(g)		600	36	0,01
SBL Holdings, Inc.				
5,125 % fällig am 13.11.2026		1.000	884	0,20
SELP Finance SARL				
3,750 % fällig am 10.08.2027	€	300	307	0,07
SMBC Aviation Capital Finance DAC				
3,550 % fällig am 15.04.2024	$	1.100	1.077	0,24
Societe Generale S.A.				
6,691 % fällig am 10.01.2034		200	204	0,05
6,750 % fällig am 06.04.2028 (e)(g)		400	325	0,07
7,375 % fällig am 04.10.2023 (e)(g)		300	292	0,07
Spirit Realty LP				
3,200 % fällig am 15.02.2031		100	82	0,02
4,000 % fällig am 15.07.2029		200	176	0,04
Standard Chartered PLC				
3,265 % fällig am 18.02.2036		200	158	0,04
6,296 % fällig am 06.07.2034 (a)		250	251	0,06
6,301 % fällig am 09.01.2029		1.000	1.006	0,23
Stifel Financial Corp.				
4,000 % fällig am 15.05.2030		600	513	0,12
STORE Capital Corp.				
4,500 % fällig am 15.03.2028		200	175	0,04
Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc.				
1,474 % fällig am 08.07.2025		1.100	1.011	0,23
3,202 % fällig am 17.09.2029 (g)		700	612	0,14
5,710 % fällig am 13.01.2030		1.100	1.114	0,25
Synchrony Financial				
7,250 % fällig am 02.02.2033		1.200	1.082	0,24
Toyota Motor Credit Corp.				
4,625 % fällig am 12.01.2028		900	893	0,20
TP ICAP Finance PLC				
5,250 % fällig am 29.05.2026	£	400	469	0,11
UBS Group AG				
2,593 % fällig am 11.09.2025	$	400	381	0,09
3,126 % fällig am 13.08.2030		900	759	0,17
4,282 % fällig am 09.01.2028		1.250	1.156	0,26
5,959 % fällig am 12.01.2034		1.400	1.394	0,31
6,537 % fällig am 12.08.2033		2.750	2.819	0,63
UDR, Inc.				
3,100 % fällig am 01.11.2034		300	239	0,05
3,500 % fällig am 15.01.2028		300	275	0,06
VICI Properties LP				
3,875 % fällig am 15.02.2029		300	264	0,06
4,500 % fällig am 15.01.2028		100	92	0,02
5,125 % fällig am 15.05.2032		600	562	0,13
5,750 % fällig am 01.02.2027		100	98	0,02
Vonovia SE				
0,000 % fällig am 01.12.2025 (c)	€	1.200	1.155	0,26
Wells Fargo & Co.				
2,393 % fällig am 02.06.2028	$	800	713	0,16
3,196 % fällig am 17.06.2027		4.400	4.134	0,93
4,897 % fällig am 25.07.2033		2.100	2.015	0,45
Weyerhaeuser Co.				
4,000 % fällig am 15.04.2030		1.300	1.197	0,27
4,750 % fällig am 15.05.2026		600	590	0,13
7,375 % fällig am 15.03.2032		343	383	0,09
			144.901	32,58

INDUSTRIEWERTE

BESCHREIBUNG		PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
AbbVie, Inc.				
4,250 % fällig am 21.11.2049		200	173	0,04
Adani Transmission Step-One Ltd.				
4,000 % fällig am 03.08.2026		400	350	0,08
Adventist Health System				
5,430 % fällig am 01.03.2032		300	298	0,07
Air Canada Pass-Through Trust				
3,300 % fällig am 15.07.2031		770	683	0,15
3,750 % fällig am 15.06.2029		132	121	0,03
5,250 % fällig am 01.10.2030		274	266	0,06
Alaska Airlines Pass-Through Trust				
4,800 % fällig am 15.02.2029	$	643	$ 619	0,14
Alcon Finance Corp.				
2,600 % fällig am 27.05.2030		500	427	0,10
Allegion U.S. Holding Co., Inc.				
3,550 % fällig am 01.10.2027		1.100	1.018	0,23
Amdocs Ltd.				
2,538 % fällig am 15.06.2030		1.600	1.337	0,30
American Airlines Pass-Through Trust				
3,200 % fällig am 15.12.2029		627	563	0,13
3,250 % fällig am 15.04.2030		697	591	0,13
3,375 % fällig am 01.11.2028		360	324	0,07
3,500 % fällig am 15.08.2033		419	342	0,08
3,575 % fällig am 15.07.2029		138	128	0,03
3,600 % fällig am 15.04.2031		219	185	0,04
4,000 % fällig am 15.01.2027		413	373	0,08
Amgen, Inc.				
5,600 % fällig am 02.03.2043		3.075	3.086	0,69
Apple, Inc.				
4,850 % fällig am 10.05.2053		2.100	2.154	0,48
ArcelorMittal S.A.				
6,800 % fällig am 29.11.2032		1.000	1.027	0,23
Ashtead Capital, Inc.				
4,000 % fällig am 01.05.2028		400	371	0,08
AstraZeneca PLC				
4,000 % fällig am 17.01.2029		500	483	0,11
Bacardi Ltd.				
5,250 % fällig am 15.01.2029		1.100	1.092	0,25
BAE Systems PLC				
3,400 % fällig am 15.04.2030		200	181	0,04
Baptist Healthcare System Obligated Group				
3,540 % fällig am 15.08.2050		300	222	0,05
BAT International Finance PLC				
1,668 % fällig am 25.03.2026		600	540	0,12
Bayer U.S. Finance LLC				
4,250 % fällig am 15.12.2025		1.100	1.062	0,24
6,562 % fällig am 15.12.2023		900	899	0,20
Berry Global, Inc.				
1,570 % fällig am 15.01.2026		1.500	1.353	0,30
Boardwalk Pipelines LP				
3,400 % fällig am 15.02.2031		500	431	0,10
Boeing Co.				
5,930 % fällig am 01.05.2060		700	694	0,16
British Airways Pass-Through Trust				
4,125 % fällig am 20.03.2033		274	244	0,05
4,250 % fällig am 15.05.2034		207	190	0,04
Broadcom, Inc.				
3,469 % fällig am 15.04.2034		569	467	0,11
Burlington Northern Santa Fe LLC				
5,200 % fällig am 15.04.2054		100	102	0,02
Caesars Entertainment, Inc.				
7,000 % fällig am 15.02.2030		400	402	0,09
Cameron LNG LLC				
3,302 % fällig am 15.01.2035		1.400	1.169	0,26
Canadian Pacific Railway Co.				
3,125 % fällig am 01.06.2026		300	281	0,06
CDW LLC				
3,569 % fällig am 01.12.2031		700	592	0,13
Centene Corp.				
2,450 % fällig am 15.07.2028		1.100	941	0,21
Charter Communications Operating LLC				
4,200 % fällig am 15.03.2028		1.300	1.219	0,27
Cheniere Energy Partners LP				
3,250 % fällig am 31.01.2032		400	330	0,07
4,000 % fällig am 01.03.2031		2.100	1.851	0,42
5,950 % fällig am 30.06.2033		600	603	0,14
Cloud Software Group, Inc.				
6,500 % fällig am 31.03.2029		100	89	0,02
Comcast Corp.				
5,500 % fällig am 15.05.2064		500	507	0,11
Continental Airlines Pass-Through Trust				
4,000 % fällig am 29.04.2026		211	204	0,05
Continental Resources, Inc.				
5,750 % fällig am 15.01.2031		400	380	0,09
CVS Health Corp.				
4,125 % fällig am 01.04.2040		900	759	0,17
5,125 % fällig am 21.02.2030	$	1.500	$ 1.491	0,34
CVS Pass-Through Trust				
5,789 % fällig am 10.01.2026		36	35	0,01
6,036 % fällig am 10.12.2028		132	131	0,03
DAE Funding LLC				
1,625 % fällig am 15.02.2024		700	675	0,15
Dell International LLC				
6,020 % fällig am 15.06.2026		1.050	1.068	0,24
6,200 % fällig am 15.07.2030		900	936	0,21
Delta Air Lines Pass-Through Trust				
2,000 % fällig am 10.12.2029		903	795	0,18
Directv Financing LLC				
5,875 % fällig am 15.08.2027		1.100	998	0,22
Eastern Gas Transmission & Storage, Inc.				
3,900 % fällig am 15.11.2049		2.300	1.701	0,38
Ecopetrol S.A.				
8,875 % fällig am 13.01.2033		300	297	0,07
eHi Car Services Ltd.				
7,000 % fällig am 21.09.2026		700	421	0,09
Elevance Health, Inc.				
4,750 % fällig am 15.02.2033		1.800	1.749	0,39
Energy Transfer LP				
4,400 % fällig am 15.03.2027		1.400	1.339	0,30
5,750 % fällig am 15.02.2033		1.000	1.008	0,23
5,950 % fällig am 01.10.2043		100	94	0,02
6,500 % fällig am 01.02.2042		100	101	0,02
EnLink Midstream LLC				
6,500 % fällig am 01.09.2030		700	700	0,16
Enterprise Products Operating LLC				
5,700 % fällig am 15.02.2042		300	305	0,07
Equifax, Inc.				
5,100 % fällig am 01.06.2028		500	493	0,11
ERAC USA Finance LLC				
3,300 % fällig am 01.12.2026		1.000	930	0,21
Expedia Group, Inc.				
5,000 % fällig am 15.02.2026		1.300	1.282	0,29
Ferguson Finance PLC				
3,250 % fällig am 02.06.2030		300	261	0,06
Flex Ltd.				
4,750 % fällig am 15.06.2025		300	293	0,07
Glencore Funding LLC				
5,400 % fällig am 08.05.2028		100	99	0,02
Global Payments, Inc.				
2,900 % fällig am 15.05.2030		600	509	0,11
Greene King Finance PLC				
5,318 % fällig am 15.09.2031	£	110	126	0,03
Greensaif Pipelines Bidco SARL				
6,129 % fällig am 23.02.2038	$	300	307	0,07
Haleon U.S. Capital LLC				
3,375 % fällig am 24.03.2029		2.400	2.182	0,49
HCA, Inc.				
3,500 % fällig am 15.07.2051		700	485	0,11
5,500 % fällig am 01.06.2033		900	899	0,20
Health & Happiness International Holdings Ltd.				
13,500 % fällig am 26.06.2026		600	568	0,13
Howard Midstream Energy Partners LLC				
8,875 % fällig am 15.07.2028 (a)		200	201	0,05
Humana, Inc.				
5,875 % fällig am 01.03.2033		800	832	0,19
Hyundai Capital America				
2,000 % fällig am 15.06.2028		1.600	1.346	0,30
Illumina, Inc.				
5,750 % fällig am 13.12.2027		900	905	0,20
Imperial Brands Finance PLC				
3,875 % fällig am 26.07.2029		1.500	1.323	0,30
4,250 % fällig am 21.07.2025		500	480	0,11
Incitec Pivot Finance LLC				
3,950 % fällig am 03.08.2027		500	469	0,11
Infor, Inc.				
1,750 % fällig am 15.07.2025		600	548	0,12
Intel Corp.				
5,200 % fällig am 10.02.2033		1.200	1.212	0,27
Jabil, Inc.				
5,450 % fällig am 01.02.2029		200	199	0,04
JetBlue Pass-Through Trust				
2,750 % fällig am 15.11.2033		252	215	0,05

BESCHREIBUNG		PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
4,000 % fällig am 15.05.2034	$	84	$ 76	0,02
Kenvue, Inc.				
5,100 % fällig am 22.03.2043		300	305	0,07
Kinder Morgan, Inc.				
4,800 % fällig am 01.02.2033		300	283	0,06
5,200 % fällig am 01.06.2033		600	582	0,13
Kraft Heinz Foods Co.				
6,875 % fällig am 26.01.2039		550	620	0,14
Las Vegas Sands Corp.				
2,900 % fällig am 25.06.2025		1.500	1.410	0,32
3,900 % fällig am 08.08.2029		600	536	0,12
Leidos, Inc.				
4,375 % fällig am 15.05.2030		600	551	0,12
Marriott International, Inc.				
3,500 % fällig am 15.10.2032		200	173	0,04
McCormick & Co., Inc.				
4,950 % fällig am 15.04.2033		900	884	0,20
Melco Resorts Finance Ltd.				
4,875 % fällig am 06.06.2025		1.000	954	0,21
5,250 % fällig am 26.04.2026		600	556	0,13
Meta Platforms, Inc.				
5,600 % fällig am 15.05.2053		800	822	0,18
MGM China Holdings Ltd.				
5,250 % fällig am 18.06.2025		900	864	0,19
5,375 % fällig am 15.05.2024		200	197	0,04
Micron Technology, Inc.				
4,663 % fällig am 15.02.2030		950	896	0,20
Mitchells & Butlers Finance PLC				
6,013 % fällig am 15.12.2030	£	418	478	0,11
Moody's Corp.				
3,250 % fällig am 20.05.2050	$	900	646	0,15
Motorola Solutions, Inc.				
2,300 % fällig am 15.11.2030		300	243	0,05
MSCI, Inc.				
3,250 % fällig am 15.08.2033		200	161	0,04
Mundys SpA				
1,875 % fällig am 12.02.2028	€	100	93	0,02
Netflix, Inc.				
4,875 % fällig am 15.06.2030	$	400	394	0,09
Newcrest Finance Pty. Ltd.				
5,750 % fällig am 15.11.2041		200	199	0,04
Norfolk Southern Corp.				
4,100 % fällig am 15.05.2049		45	38	0,01
Northern Star Resources Ltd.				
6,125 % fällig am 11.04.2033		1.100	1.068	0,24
NVR, Inc.				
3,000 % fällig am 15.05.2030		300	260	0,06
NXP BV				
4,875 % fällig am 01.03.2024		1.100	1.092	0,25
Occidental Petroleum Corp.				
8,875 % fällig am 15.07.2030		1.300	1.495	0,34
OCI NV				
6,700 % fällig am 16.03.2033		400	391	0,09
Oracle Corp.				
4,000 % fällig am 15.07.2046		600	462	0,10
4,000 % fällig am 15.11.2047		600	462	0,10
4,650 % fällig am 06.05.2030		1.100	1.064	0,24
6,250 % fällig am 09.11.2032 (h)		1.000	1.062	0,24
Pacific National Finance Pty. Ltd.				
4,750 % fällig am 22.03.2028		1.700	1.546	0,35
Penske Truck Leasing Co. LP				
4,450 % fällig am 29.01.2026		100	96	0,02
Petroleos Mexicanos				
7,690 % fällig am 23.01.2050		100	68	0,02
10,000 % fällig am 07.02.2033		400	367	0,08
Pfizer Investment Enterprises Pte. Ltd.				
5,340 % fällig am 19.05.2063		1.300	1.317	0,30
Philip Morris International, Inc.				
5,125 % fällig am 15.02.2030		2.000	1.979	0,45
5,750 % fällig am 17.11.2032		200	205	0,05
Phosagro OAO Via Phosagro Bond Funding DAC				
3,050 % fällig am 23.01.2025 ^		400	345	0,08
POSCO				
5,625 % fällig am 17.01.2026		900	896	0,20
Royalty Pharma PLC				
3,550 % fällig am 02.09.2050		711	481	0,11

BESCHREIBUNG		PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
Sabine Pass Liquefaction LLC				
5,000 % fällig am 15.03.2027	$	300	$ 295	0,07
Sands China Ltd.				
3,350 % fällig am 08.03.2029		1.000	834	0,19
3,750 % fällig am 08.08.2031		400	326	0,07
Santos Finance Ltd.				
5,250 % fällig am 13.03.2029		1.600	1.506	0,34
Spirit AeroSystems, Inc.				
9,375 % fällig am 30.11.2029		200	214	0,05
Spirit Airlines Pass-Through Trust				
3,650 % fällig am 15.08.2031		435	361	0,08
4,100 % fällig am 01.10.2029		117	106	0,02
Sutter Health				
5,164 % fällig am 15.08.2033		100	100	0,02
Sysco Corp.				
3,150 % fällig am 14.12.2051		300	208	0,05
T-Mobile USA, Inc.				
2,550 % fällig am 15.02.2031		4.300	3.576	0,80
2,875 % fällig am 15.02.2031		365	309	0,07
Targa Resources Corp.				
5,200 % fällig am 01.07.2027		700	688	0,15
6,125 % fällig am 15.03.2033		200	204	0,05
TD SYNNEX Corp.				
1,750 % fällig am 09.08.2026		2.300	2.006	0,45
Tencent Music Entertainment Group				
2,000 % fällig am 03.09.2030		400	316	0,07
Tennessee Gas Pipeline Co. LLC				
7,000 % fällig am 15.10.2028		900	951	0,21
Time Warner Cable LLC				
5,875 % fällig am 15.11.2040		1.400	1.236	0,28
Transcontinental Gas Pipe Line Co. LLC				
4,000 % fällig am 15.03.2028		900	848	0,19
Transurban Finance Co. Pty. Ltd.				
2,450 % fällig am 16.03.2031		150	123	0,03
Trimble, Inc.				
6,100 % fällig am 15.03.2033		100	101	0,02
U.S. Airways Pass-Through Trust				
5,900 % fällig am 01.04.2026		198	197	0,04
United Airlines Pass-Through Trust				
2,700 % fällig am 01.11.2033		344	289	0,07
2,875 % fällig am 07.04.2030		382	337	0,08
3,100 % fällig am 07.04.2030		213	181	0,04
3,700 % fällig am 01.09.2031		471	408	0,09
3,750 % fällig am 03.03.2028		581	546	0,12
4,000 % fällig am 11.10.2027		169	159	0,04
4,150 % fällig am 11.10.2025		508	499	0,11
4,550 % fällig am 25.02.2033		75	67	0,02
UnitedHealth Group, Inc.				
5,200 % fällig am 15.04.2063		900	901	0,20
Venture Global Calcasieu Pass LLC				
6,250 % fällig am 15.01.2030		2.000	1.986	0,45
Venture Global LNG, Inc.				
8,375 % fällig am 01.06.2031		800	808	0,18
Verisk Analytics, Inc.				
4,125 % fällig am 15.03.2029		200	191	0,04
VMware, Inc.				
4,650 % fällig am 15.05.2027		350	340	0,08
4,700 % fällig am 15.05.2030		900	860	0,19
Warnermedia Holdings, Inc.				
4,279 % fällig am 15.03.2032		800	710	0,16
5,050 % fällig am 15.03.2042		1.500	1.265	0,28
Waste Connections, Inc.				
4,200 % fällig am 15.01.2033		900	847	0,19
Weibo Corp.				
3,375 % fällig am 08.07.2030		700	558	0,13
Weir Group PLC				
2,200 % fällig am 13.05.2026		1.300	1.165	0,26
Western Midstream Operating LP				
6,150 % fällig am 01.04.2033		700	707	0,16
Woodside Finance Ltd.				
3,650 % fällig am 05.03.2025		1.100	1.059	0,24
Xiaomi Best Time International Ltd.				
2,875 % fällig am 14.07.2031		400	303	0,07
Zimmer Biomet Holdings, Inc.				
4,250 % fällig am 15.08.2035		228	198	0,04
			117.237	26,36

BESCHREIBUNG		PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
VERSORGUNGSUNTERNEHMEN				
AEP Texas, Inc.				
5,400 % fällig am 01.06.2033	$	1.100	$ 1.095	0,25
6,650 % fällig am 15.02.2033		300	322	0,07
Ameren Illinois Co.				
3,250 % fällig am 15.03.2050		400	294	0,07
Appalachian Power Co.				
7,000 % fällig am 01.04.2038		900	1.014	0,23
Black Hills Corp.				
1,037 % fällig am 23.08.2024		400	378	0,09
CenterPoint Energy Houston Electric LLC				
5,300 % fällig am 01.04.2053		500	512	0,12
CenterPoint Energy, Inc.				
4,250 % fällig am 01.11.2028		90	84	0,02
Clearway Energy Operating LLC				
3,750 % fällig am 15.02.2031		200	166	0,04
Cleveland Electric Illuminating Co.				
3,500 % fällig am 01.04.2028		1.561	1.432	0,32
Connecticut Light and Power Co.				
4,900 % fällig am 01.07.2033 (a)		1.000	995	0,22
Consolidated Edison Co. of New York, Inc.				
5,300 % fällig am 01.03.2035		900	890	0,20
Dominion Energy, Inc.				
5,375 % fällig am 15.11.2032		100	100	0,02
DTE Electric Co.				
5,200 % fällig am 01.04.2033		100	102	0,02
DTE Energy Co.				
2,950 % fällig am 01.03.2030		600	520	0,12
Duke Energy Carolinas LLC				
6,000 % fällig am 15.01.2038		50	52	0,01
Duke Energy Ohio, Inc.				
5,650 % fällig am 01.04.2053		2.400	2.465	0,55
Edison International				
6,950 % fällig am 15.11.2029		100	105	0,02
8,125 % fällig am 15.06.2053		300	307	0,07
EDP Finance BV				
6,300 % fällig am 11.10.2027		900	924	0,21
Enel Finance America LLC				
7,100 % fällig am 14.10.2027		600	631	0,14
Entergy Corp.				
1,900 % fällig am 15.06.2028		200	171	0,04
Entergy Mississippi LLC				
2,850 % fällig am 01.06.2028		700	628	0,14
Exelon Corp.				
4,050 % fällig am 15.04.2030		800	748	0,17
FirstEnergy Transmission LLC				
4,350 % fällig am 15.01.2025		500	488	0,11
India Green Energy Holdings				
5,375 % fällig am 29.04.2024		250	244	0,05
Interstate Power & Light Co.				
3,600 % fällig am 01.04.2029		1.400	1.280	0,29
Ipalco Enterprises, Inc.				
3,700 % fällig am 01.09.2024		1.500	1.451	0,33
Jersey Central Power & Light Co.				
4,300 % fällig am 15.01.2026		1.100	1.065	0,24
Louisville Gas and Electric Co.				
5,450 % fällig am 15.04.2033		700	714	0,16
MidAmerican Energy Co.				
2,700 % fällig am 01.08.2052		100	63	0,01
Mississippi Power Co.				
3,950 % fällig am 30.03.2028		500	471	0,11
National Grid PLC				
5,809 % fällig am 12.06.2033		500	509	0,11
NextEra Energy Capital Holdings, Inc.				
5,050 % fällig am 28.02.2033		600	591	0,13
NiSource, Inc.				
3,600 % fällig am 01.05.2030		300	271	0,06
Oklahoma Gas & Electric Co.				
5,400 % fällig am 15.01.2033		200	203	0,05
ONEOK, Inc.				
4,350 % fällig am 15.03.2029		200	186	0,04
4,550 % fällig am 15.07.2028		200	190	0,04
6,100 % fällig am 15.11.2032		500	509	0,11
Pacific Gas & Electric Co.				
2,100 % fällig am 01.08.2027		2.300	1.966	0,44

BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
3,000 % fällig am 15.06.2028	$ 900	$ 777	0,17
3,150 % fällig am 01.01.2026	700	650	0,15
3,750 % fällig am 01.07.2028	300	269	0,06
4,250 % fällig am 15.03.2046 ^	1.100	784	0,18
4,300 % fällig am 15.03.2045 ^	100	71	0,02
6,750 % fällig am 15.01.2053	400	395	0,09
PECO Energy Co.			
3,000 % fällig am 15.09.2049	100	70	0,02
PPL Electric Utilities Corp.			
5,000 % fällig am 15.05.2033	300	300	0,07
Progress Energy, Inc.			
7,750 % fällig am 01.03.2031	204	231	0,05
San Diego Gas & Electric Co.			
5,350 % fällig am 01.04.2053	1.100	1.092	0,25
SCE Recovery Funding LLC			
5,112 % fällig am 14.12.2049	200	198	0,04
Southern California Edison Co.			
2,850 % fällig am 01.08.2029	800	700	0,16
3,900 % fällig am 01.12.2041	108	85	0,02
4,200 % fällig am 01.03.2029	200	190	0,04
5,300 % fällig am 01.03.2028	700	701	0,16
6,650 % fällig am 01.04.2029	2.035	2.109	0,47
Southern California Gas Co.			
5,200 % fällig am 01.06.2033	1.300	1.283	0,29
Southern Co. Gas Capital Corp.			
3,250 % fällig am 15.06.2026	2.700	2.546	0,57
Southwest Gas Corp.			
5,800 % fällig am 01.12.2027	1.000	1.011	0,23
Southwestern Public Service Co.			
3,750 % fällig am 15.06.2049	500	384	0,09
Sprint LLC			
7,875 % fällig am 15.09.2023	400	401	0,09
System Energy Resources, Inc.			
2,140 % fällig am 09.12.2025	800	726	0,16
6,000 % fällig am 15.04.2028	600	594	0,13
Targa Resources Partners LP			
5,500 % fällig am 01.03.2030	300	289	0,06
Transcanada Trust			
5,300 % fällig am 15.03.2077	50	45	0,01
		40.037	9,00
Summe Unternehmensanleihen und Wechsel		302.175	67,94
KOMMUNALANLEIHEN UND WECHSEL			
Texas Natural Gas Securitization Finance Corp. Revenue Bonds, Series 2023			
5,102 % fällig am 01.04.2035	600	603	0,13
US-REGIERUNGSBEHÖRDEN			
Uniform Mortgage-Backed Security			
3,000 % fällig am 01.05.2052	886	782	0,18
Uniform Mortgage-Backed Security, TBA			
3,500 % fällig am 01.08.2053	7.340	6.696	1,50
4,000 % fällig am 01.07.2053	12.000	11.266	2,53
4,500 % fällig am 01.07.2053	3.000	2.884	0,65
5,000 % fällig am 01.09.2053	4.000	3.922	0,88
		25.550	5,74

BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
US-SCHATZOBLIGATIONEN			
U.S. Treasury Bonds			
3,875 % fällig am 15.02.2043	$ 3.600	$ 3.511	0,79
4,000 % fällig am 15.11.2042	10.700	10.637	2,39
U.S. Treasury Inflation Protected Securities (d)			
0,750 % fällig am 15.02.2045	773	639	0,14
1,500 % fällig am 15.02.2053	3.459	3.362	0,76
U.S. Treasury Notes			
2,750 % fällig am 15.08.2032	1.900	1.742	0,39
2,875 % fällig am 15.05.2032	3.401	3.154	0,71
3,375 % fällig am 15.05.2033	7.700	7.427	1,67
3,500 % fällig am 15.02.2033	4.400	4.286	0,96
		34.758	7,81
NON-AGENCY-MBS			
Barclays Commercial Mortgage Securities Trust			
6,193 % fällig am 15.10.2037	260	254	0,06
CityLine Commercial Mortgage Trust			
2,871 % fällig am 10.11.2031	1.000	933	0,21
Countrywide Alternative Loan Trust			
5,326 % fällig am 25.08.2035 ^	33	26	0,01
Countrywide Home Loan Reperforming REMIC Trust			
5,590 % fällig am 25.11.2034	155	146	0,03
		1.359	0,31
FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE			
ACE Securities Corp. Home Equity Loan Trust			
6,080 % fällig am 25.02.2036 ^	206	187	0,04
Citigroup Mortgage Loan Trust			
5,350 % fällig am 25.01.2037	1.111	476	0,11
Ellington Loan Acquisition Trust			
6,250 % fällig am 25.05.2037	193	185	0,04
LCM LP			
6,270 % fällig am 20.04.2031	1.100	1.088	0,25
Long Beach Mortgage Loan Trust			
6,125 % fällig am 25.07.2034	912	884	0,20
New Century Home Equity Loan Trust			
5,855 % fällig am 25.02.2036	182	152	0,03
		2.972	0,67
STAATSEMISSIONEN			
Emirate of Abu Dhabi Government International Bond			
3,125 % fällig am 16.04.2030	600	557	0,13
Export-Import Bank of India			
3,250 % fällig am 15.01.2030	400	353	0,08
Italy Government International Bond			
6,875 % fällig am 27.09.2023	600	601	0,13
Romania Government International Bond			
3,750 % fällig am 07.02.2034 €	400	354	0,08
South Africa Government International Bond			
10,500 % fällig am 21.12.2026 ZAR	62.900	3.458	0,78
		5.323	1,20

BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
STAMMAKTIEN			
FINANZWERTE			
Stearns Holdings LLC 'B' (b)	14.062	$ 0	0,00
OPTIONSSCHEINE			
Guaranteed Rate, Inc. - Exp. 31.12.2060	68	0	0,00
VORZUGSWERTPAPIERE			
Wells Fargo & Co.			
4,250 % fällig am 15.09.2026 (e)	40.800	696	0,16
KURZFRISTIGE INSTRUMENTE			
COMMERCIAL PAPER			
AT+T, Inc.			
5,700 % fällig am 19.03.2024	$ 2.300	2.202	0,49
Dominion Resources, Inc.			
5,490 % fällig am 10.07.2023	1.700	1.698	0,38
5,520 % fällig am 18.08.2023	300	298	0,07
Electricite de France S.A.			
5,510 % fällig am 04.08.2023	800	796	0,18
Enbridge, Inc.			
5,400 % fällig am 12.07.2023	1.200	1.198	0,27
Humana, Inc.			
5,450 % fällig am 10.07.2023	1.800	1.797	0,40
J.M. Smucker Co.			
5,450 % fällig am 12.07.2023	300	299	0,07
Keurig Dr Pepper, Inc.			
5,350 % fällig am 20.07.2023	500	498	0,11
Mondelez International, Inc.			
5,370 % fällig am 25.07.2023	500	498	0,11
Walgreens Boots Alliance			
6,000 % fällig am 06.07.2023	1.500	1.499	0,34
Summe kurzfristige Instrumente		10.783	2,42
Summe Übertragbare Wertpapiere		**$ 384.707**	**86,49**
	AKTIEN		
INVESTMENTFONDS			
ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN			
PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (f)	4.371.784	43.534	9,79
Summe Investmentfonds		**$ 43.534**	**9,79**

PENSIONSGESCHÄFTE

Kontrahent	Kredit-zins	Abrechnungs-datum	Fälligkeits-datum	Kapital-betrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensions-geschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensions-geschäft[1]	% des Netto-vermögens
BPS	5,180 %	30.06.2023	03.07.2023	$ 22.300	U.S. Treasury Notes 0,375 % fällig am 30.04.2025	$ (22.755)	$ 22.300	$ 22.310	5,01
FICC	2,400	30.06.2023	03.07.2023	2.968	U.S. Treasury Notes 4,625 % fällig am 30.06.2025	(3.027)	2.968	2.968	0,67
Summe Pensionsgeschäfte						**$ (25.782)**	**$ 25.268**	**$ 25.278**	**5,68**

(1) Umfasst aufgelaufene Zinsen.

AN EINEM GEREGELTEN MARKT GEHANDELTE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*, außer Anzahl der Kontrakte)

*** Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt**

FUTURES

Beschreibung	Art	Ablauf-monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
3-Month SOFR December Futures	Long	03.2024	27	$ (43)	(0,01)
Euro-Bobl September Futures	Long	09.2023	4	(7)	0,00
Euro-Bund 10-Year Bond September Futures	Short	09.2023	9	12	0,00
U.S. Treasury 10-Year Note September Futures	Long	09.2023	8	(7)	0,00
U.S. Treasury 30-Year Bond September Futures	Long	09.2023	386	506	0,11
U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond September Futures	Long	09.2023	28	46	0,01
				$ 507	0,11

VERKAUFSOPTIONEN

OPTIONEN AUF BÖRSENGEHANDELTE TERMINKONTRAKTE

Beschreibung	Ausübungskurs	Verfalls-datum	Anzahl der Kontrakte	Aufgeld	Markt-wert	% des Nettovermögens
Put - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note August Futures	$ 111,500	21.07.2023	10	$ (4)	$ (4)	0,00
Call - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note August Futures	115,500	21.07.2023	10	(4)	0	0,00
Put - CBOT U.S. Treasury 30-Year Bond August Futures	123,000	21.07.2023	3	(1)	0	0,00
Call - CBOT U.S. Treasury 30-Year Bond August Futures	131,000	21.07.2023	3	(2)	(1)	0,00
				$ (11)	$ (5)	0,00

Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate **$ 502** **0,11**

ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)

*** Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt**

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMMISSIONEN - SCHUTZVERKAUF[1]

Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag[2]	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Airbus Finance BV	1,000 %	20.12.2025	€ 200	$ 0	0,00
American International Group, Inc.	1,000	20.12.2026	$ 500	(4)	0,00
AT&T, Inc.	1,000	20.12.2023	1.400	(14)	0,00
AT&T, Inc.	1,000	20.06.2024	1.100	5	0,00
AT&T, Inc.	1,000	20.12.2026	900	(8)	0,00
Barclays Bank PLC	1,000	20.12.2023	€ 1.500	0	0,00
Boeing Co.	1,000	20.12.2025	$ 200	5	0,00
Boeing Co.	1,000	20.12.2026	500	7	0,00
Boeing Co.	1,000	20.06.2027	2.900	183	0,04
BP Capital Markets PLC	1,000	20.12.2025	€ 700	(3)	0,00
British Telecommunications PLC	1,000	20.12.2024	400	(2)	0,00
British Telecommunications PLC	1,000	20.12.2025	200	0	0,00
British Telecommunications PLC	1,000	20.12.2027	300	4	0,00
British Telecommunications PLC	1,000	20.06.2028	1.100	3	0,00
Devon Energy Corp.	1,000	20.12.2026	$ 800	9	0,00
Enbridge, Inc.	1,000	20.12.2026	900	1	0,00
Exelon Generation Co. LLC	1,000	20.12.2024	1.600	(2)	0,00
Expedia Group, Inc.	1,000	20.12.2026	300	0	0,00
Ford Motor Co.	5,000	20.12.2024	1.300	(79)	(0,02)
General Electric Co.	1,000	20.12.2023	500	7	0,00
General Electric Co.	1,000	20.06.2024	300	7	0,00
General Electric Co.	1,000	20.06.2026	1.200	3	0,00
General Electric Co.	1,000	20.12.2026	200	0	0,00
General Motors Co.	5,000	20.12.2026	710	(57)	(0,01)
General Motors Co.	5,000	20.06.2028	890	19	0,01
Hess Corp.	1,000	20.12.2026	1.200	11	0,00
MetLife, Inc.	1,000	20.12.2023	200	(4)	0,00
MetLife, Inc.	1,000	20.12.2024	1.400	(28)	(0,01)
National Rural Utilities Cooperative Finance Corp.	1,000	20.12.2026	200	0	0,00
Rolls-Royce PLC	1,000	20.12.2024	€ 1.600	219	0,05
Southwest Airlines Co.	1,000	20.12.2026	$ 550	7	0,00
Telefonica Emisiones S.A.	1,000	20.06.2028	€ 800	2	0,00
Tesco PLC	1,000	20.12.2024	1.000	(12)	0,00
Tesco PLC	1,000	20.12.2027	2.400	22	0,01
Tesco PLC	1,000	20.06.2028	500	2	0,00
Verizon Communications, Inc.	1,000	20.06.2026	$ 1.200	(19)	0,00
Verizon Communications, Inc.	1,000	20.12.2026	1.800	(30)	(0,01)
Verizon Communications, Inc.	1,000	20.06.2028	1.400	4	0,00
Vodafone Group PLC	1,000	20.06.2024	€ 200	(4)	0,00
Volkswagen International Finance NV	1,000	20.06.2028	1.600	(25)	(0,01)
				$ 229	0,05

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES - SCHUTZVERKAUF[1]

Index/Tranchen	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag[2]	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
CDX.IG-40 5-Year Index	1,000 %	20.06.2028	$ 100.700	$ 712	0,16

ZINSSWAPS

Zahlung/ Erhalt variabel Zinssatz	Variabler Zinssatzindex	Fest-Zinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
Zahlung	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	1,175 %	28.02.2052	£ 200	$ (114)	(0,02)
Erhalt[3]	1-Day GBP-SONIO Compounded-OIS	3,500	20.09.2033	600	49	0,01
Erhalt	1-Day JPY-MUTKCALM Compounded-OIS	0,300	20.03.2028	¥ 231.200	47	0,01
Erhalt	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	0,000	04.08.2023	$ 25.000	345	0,08
Zahlung	1-Day USD-Secured Overnight Financing Rate Compounded-OIS	1,270	04.11.2023	25.000	(86)	(0,02)
Zahlung	3-Month USD-LIBOR	0,000	04.08.2023	25.000	(343)	(0,08)
Erhalt	3-Month ZAR-JIBAR	7,195	25.04.2027	ZAR 22.300	52	0,01
Erhalt	3-Month ZAR-JIBAR	7,300	28.04.2027	3.900	8	0,00
Erhalt	6-Month EUR-EURIBOR	0,000	17.03.2053	€ 3.850	1.810	0,41
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	0,550	10.08.2024	1.600	(71)	(0,01)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	1,000	13.05.2027	3.300	(310)	(0,07)
Zahlung	6-Month EUR-EURIBOR	1,000	18.05.2027	1.400	(131)	(0,03)
Zahlung	6-Month HUF-BBR	1,000	19.09.2023	HUF 115.000	(25)	(0,01)
Zahlung	6-Month HUF-BBR	1,250	19.09.2023	352.100	(84)	(0,02)
					$ 1.147	0,26
Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate					**$ 2.088**	**0,47**

(1) Agiert der Fonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Fonds entweder (i) dem Sicherungsnehmer einen Betrag, der dem Nennwert des Swaps entspricht, und erhält die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er zahlt einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.

(2) Der maximal mögliche Betrag, den der Fonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

(3) Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft.

DERIVATIVE OTC-FINANZINSTRUMENTE (Beträge in Tausend*, außer Anzahl der Kontrakte)

*** Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt**

VERKAUFSOPTIONEN

ZINSSWAPOPTIONEN

Kontrahent	Beschreibung	Variabler Zinssatzindex	Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz	Ausübungs-kurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag[1]	Aufgeld	Markt-wert	% des Nettovermögens
BOA	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,380 %	31.07.2023	500	$ (2)	$ (2)	(0,01)
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,780	31.07.2023	500	(2)	(2)	0,00
	Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,070	10.07.2023	300	(2)	(1)	0,00
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,370	10.07.2023	300	(2)	0	0,00
	Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,060	14.07.2023	200	(1)	(1)	0,00
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,360	14.07.2023	200	(1)	(1)	0,00
BPS	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,200	06.07.2023	200	(1)	0	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,650	06.07.2023	200	(1)	0	0,00
	Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,000	03.07.2023	200	(1)	0	0,00
	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,400	03.07.2023	200	(1)	0	0,00
BRC	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,260	26.07.2023	200	(1)	(1)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,660	26.07.2023	200	(1)	(1)	0,00
	Call - OTC 7-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,350	27.07.2023	200	0	0	0,00
	Put - OTC 7-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,850	27.07.2023	200	0	(1)	0,00
GLM	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,260	26.07.2023	200	(1)	0	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,660	26.07.2023	200	(1)	(1)	0,00
	Call - OTC 7-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,350	27.07.2023	200	0	0	0,00
	Put - OTC 7-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,850	27.07.2023	200	0	(1)	0,00
JPM	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,300	10.07.2023	200	(1)	0	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,750	10.07.2023	200	(1)	0	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,250	20.07.2023	500	(1)	(1)	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,650	20.07.2023	500	(1)	(2)	0,00
MYC	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,200	06.07.2023	200	(1)	0	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,650	06.07.2023	200	(1)	0	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,300	10.07.2023	200	(1)	0	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,750	10.07.2023	200	(1)	0	0,00
	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Erhalt	3,270	24.07.2023	200	(1)	0	0,00
	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Zahlung	3,670	24.07.2023	200	(1)	(1)	0,00
							$ (28)	$ (16)	(0,01)

OPTIONEN AUF WERTPAPIERE

Kontrahent	Beschreibung	Ausübungskurs	Verfalls-datum	Nenn-betrag[1]	Aufgeld	Markt-wert	% des Nettovermögens
SAL	Put - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 4,500 % fällig am 01.08.2053	$ 95,875	07.08.2023	600	$ (4)	$ (3)	0,00
	Call - OTC Uniform Mortgage-Backed Security, TBA 4,500 % fällig am 01.08.2053	97,875	07.08.2023	600	(3)	(1)	0,00
					$ (7)	$ (4)	0,00

(1) Der Nennbetrag stellt die Anzahl der Kontrakte dar.

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMMISSIONEN - SCHUTZVERKAUF[1]

Kontrahent	Referenzeinheit	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag[2]	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Markt-wert	% des Nettovermögens
BOA	Brazil Government International Bond	1,000 %	20.06.2026	$ 100	$ (4)	$ 4	$ 0	0,00
BRC	Alibaba Group Holding Ltd.	1,000	20.12.2024	400	5	(2)	3	0,00
	Italy Government International Bond	1,000	20.06.2025	2.800	(41)	77	36	0,01
	NextEra Energy Capital Holdings, Inc.	1,000	20.12.2025	500	11	(5)	6	0,00
	Pertamina Persero PT	1,000	20.12.2024	400	(2)	6	4	0,00
DUB	Saudi Arabia Government International Bond	1,000	20.06.2025	300	0	4	4	0,00
GLM	Italy Government International Bond	1,000	20.06.2025	2.300	(26)	65	39	0,01
GST	Mexico Government International Bond	1,000	20.12.2024	200	(2)	4	2	0,00
	Saudi Arabia Government International Bond	1,000	20.06.2025	300	0	4	4	0,00
JPM	Banco do Brasil S.A.	1,000	20.12.2024	400	(9)	6	(3)	0,00
	Saudi Arabia Government International Bond	1,000	20.06.2025	400	0	5	5	0,00
MYC	Brazil Government International Bond	1,000	20.06.2027	1.000	(62)	50	(12)	0,00
	Brookfield Asset Management, Inc.	1,000	20.06.2025	300	0	(2)	(2)	0,00
	Mexico Government International Bond	1,000	20.12.2024	100	(1)	2	1	0,00
	Mexico Government International Bond	1,000	20.12.2026	200	1	1	2	0,00
	Mexico Government International Bond	1,000	20.06.2028	400	(10)	10	0	0,00
					$ (140)	$ 229	$ 89	0,02

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES - SCHUTZVERKAUF[1]

Kontrahent	Index/Tranchen	Zu erhaltender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag[2]	Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	Markt-wert	% des Netto-vermögens
BPS	CDX.HY-31 5-Year Index 25-35 %	5,000 %	20.12.2023	$ 100	$ 12	$ (9)	$ 3	0,00
CBK	CDX.HY-31 5-Year Index 25-35 %	5,000	20.12.2023	100	10	(8)	2	0,00
GST	CDX.HY-31 5-Year Index 25-35 %	5,000	20.12.2023	400	48	(38)	10	0,01
JPM	CDX.HY-31 5-Year Index 25-35 %	5,000	20.12.2023	300	33	(26)	7	0,00
					$ 103	$ (81)	$ 22	0,01

(1) Agiert der Fonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Fonds entweder (i) dem Sicherungsnehmer einen Betrag, der dem Nennwert des Swaps entspricht, und erhält die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er zahlt einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.

(2) Der maximal mögliche Betrag, den der Fonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung		Zu erhaltende Währung		Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
AZD	07.2023	AUD	449	$	298	$ 0	$ (1)	$ (1)	0,00
	07.2023	$	575	AUD	879	10	0	10	0,00
	08.2023		298		449	1	0	1	0,00
BOA	07.2023	DKK	1.999	$	289	0	(4)	(4)	0,00
	07.2023	¥	5.700		41	2	0	2	0,00
	07.2023	MXN	12.767		728	0	(15)	(15)	0,00
	07.2023	$	1.172	AUD	1.806	31	0	31	0,01
	07.2023		533	DKK	3.625	0	(2)	(2)	0,00
	08.2023	DKK	3.619	$	533	2	0	2	0,00
	08.2023	$	182	ZAR	3.322	0	(7)	(7)	0,00
	09.2023		175	IDR	2.623.448	0	(1)	(1)	0,00
BPS	07.2023	AUD	1.360	$	901	0	(4)	(4)	0,00
	07.2023	$	4.338	¥	603.008	0	(166)	(166)	(0,04)
	08.2023		902	AUD	1.360	4	0	4	0,00
	08.2023		2.486	MXN	43.281	17	0	17	0,00
	08.2023	ZAR	17.426	$	937	18	0	18	0,01
	09.2023	$	164	IDR	2.458.019	0	0	0	0,00
	10.2023	ZAR	8.009	$	430	11	0	11	0,00
BRC	08.2023	$	993	COP	4.231.838	8	0	8	0,00
	08.2023	ZAR	20.839	$	1.127	29	0	29	0,01
	09.2023	IDR	7.880		1	0	0	0	0,00
	09.2023	$	216	PEN	792	1	0	1	0,00
BSH	07.2023		112		413	2	0	2	0,00
CBK	07.2023	€	2.242	$	2.406	0	(40)	(40)	(0,01)
	07.2023	$	1.262	PEN	4.628	14	0	14	0,00

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung		Zu erhaltende Währung		Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
	08.2023	PEN	8.086	$	2.070	$ 0	$ (153)	$ (153)	(0,03)
	08.2023	$	1.615	CLP	1.338.260	47	0	47	0,01
	08.2023		292	NOK	3.051	0	(7)	(7)	0,00
	09.2023	ZAR	10.952	$	620	44	0	44	0,01
CLY	07.2023	DKK	5.874		848	0	(13)	(13)	0,00
	08.2023	$	330	NOK	3.460	0	(7)	(7)	0,00
GLM	07.2023	PEN	3.280	$	898	0	(6)	(6)	0,00
	07.2023	$	84	PEN	307	0	0	0	0,00
	08.2023	CLP	1.328.207	$	1.623	0	(27)	(27)	(0,01)
	08.2023	$	129	NOK	1.364	0	(1)	(1)	0,00
	08.2023		414	PEN	1.511	1	0	1	0,00
	08.2023	ZAR	4.906	$	264	6	0	6	0,00
	09.2023	$	653	PEN	2.398	5	0	5	0,00
JPM	07.2023	¥	203.411	$	1.422	15	0	15	0,00
	07.2023	$	1.006	£	796	6	0	6	0,00
	08.2023	£	796	$	1.006	0	(6)	(6)	0,00
	08.2023	$	1.422	¥	202.546	0	(15)	(15)	0,00
	08.2023		47	NOK	503	0	0	0	0,00
	09.2023		73	IDR	1.102.119	0	0	0	0,00
	09.2023		715	INR	58.889	1	0	1	0,00
	10.2023		432	MXN	7.579	2	0	2	0,00
MYI	07.2023	£	826	$	1.028	0	(23)	(23)	(0,01)
	07.2023	IDR	691.578		46	0	0	0	0,00
	07.2023	$	474	DKK	3.233	0	0	0	0,00
	07.2023		307	£	243	2	0	2	0,00
	07.2023		46	IDR	691.578	0	0	0	0,00
	08.2023	CLP	10.053	$	12	0	0	0	0,00
	08.2023	DKK	3.227		474	0	0	0	0,00
	09.2023	$	209	IDR	3.116.556	0	(2)	(2)	0,00
	09.2023		154	INR	12.720	0	0	0	0,00
SCX	07.2023	AUD	660	$	438	0	(1)	(1)	0,00
	08.2023	$	438	AUD	660	1	0	1	0,00
	09.2023		679	IDR	10.144.750	0	(5)	(5)	0,00
	09.2023		447	INR	36.830	0	0	0	0,00
	09.2023		350	PEN	1.290	4	0	4	0,00
SSB	09.2023		453	BRL	2.298	18	0	18	0,00
						$ 302	$ (506)	$ (204)	(0,05)

ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklasse Institutional EUR (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung		Zu erhaltende Währung		Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2023	$	39.283	€	36.552	$ 596	$ 0	$ 596	0,13
BPS	07.2023	€	33.544	$	36.754	157	0	157	0,04
	07.2023	$	39.146	€	36.414	582	0	582	0,13
	08.2023		36.792		33.532	0	(159)	(159)	(0,04)
BRC	07.2023	€	817	$	894	2	0	2	0,00
	07.2023	$	747	€	697	13	0	13	0,00
CBK	07.2023	€	36.100	$	39.220	0	(165)	(165)	(0,04)
	08.2023	$	36.801	€	33.802	127	0	127	0,03
DUB	07.2023	€	9.487	$	10.148	0	(204)	(204)	(0,04)
JPM	07.2023		33.820		36.928	30	0	30	0,01
	07.2023	$	36.212	€	33.869	740	0	740	0,17
	08.2023		36.980		33.820	0	(31)	(31)	(0,01)
MYI	07.2023	€	15	$	16	0	0	0	0,00
	07.2023	$	566	€	516	0	(3)	(3)	0,00
SCX	07.2023		6.139		5.736	120	0	120	0,03
						$ 2.367	$ (562)	$ 1.805	0,41

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklasse Institutional GBP (Hedged) ausschüttend II die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung		Zu erhaltende Währung		Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2023	£	45	$	58	$ 0	$ 0	$ 0	0,00
	07.2023	$	248	£	196	1	0	1	0,00
BPS	07.2023	£	4	$	5	0	0	0	0,00
	07.2023	$	9.621	£	7.771	261	(2)	259	0,06
BRC	07.2023	£	38	$	49	0	0	0	0,00
	07.2023	$	392	£	311	3	0	3	0,00
CBK	07.2023		21		17	0	0	0	0,00
JPM	07.2023	£	7.758	$	9.809	0	(54)	(54)	(0,01)
	07.2023	$	6	£	5	0	0	0	0,00
	08.2023		9.761		7.718	54	0	54	0,01

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung	Zu erhaltende Währung	Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
MYI	07.2023	£ 116	$ 148	$ 0	$ 0	$ 0	0,00
	07.2023	$ 9.282	£ 7.468	212	0	212	0,05
SCX	07.2023	£ 24	$ 29	0	(1)	(1)	0,00
	07.2023	$ 9.419	£ 7.561	194	0	194	0,04
				$ 725	$ (57)	$ 668	0,15

Summe Freiverkehrsfinanzderivate	**$ 2.360**	**0,53**
Summe Anlagen	**$ 458.459**	**103,07**
Sonstige Aktiva und Passiva	**$ (13.666)**	**(3,07)**
Nettovermögen	**$ 444.793**	**100,00**

ERLÄUTERUNGEN ZUR AUFSTELLUNG DES WERTPAPIERBESTANDS (Angaben in Tausend*):

***** **Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt**

^ **Das Wertpapier ist in Verzug.**

(a) **Wertpapier per Emissionstermin.**

(b) **Das Wertpapier hat in den letzten zwölf Monaten keine Erträge geliefert.**

(c) **Nullkuponwertpapier.**

(d) **Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.**

(e) **Unbegrenzte Laufzeit; das gegebenenfalls angegebene Datum stellt den nächsten vertraglichen Kündigungstermin dar.**

(f) **Mit dem Fonds verbunden.**

(g) **Bedingt wandelbares Wertpapier.**

(h) **Eingeschränkte Wertpapiere (31. Dezember 2022: 0,92 %):**

Emittentenbeschreibung	Kupon	Fälligkeits-datum	Kauf-datum	Kosten	Markt-wert	% des Nettovermögens
Citigroup, Inc.	3,785 %	17.03.2033	10.03.2022	$ 200	$ 177	0,04
Citigroup, Inc.	6,270	17.11.2033	09.11.2022	2.000	2.124	0,48
Oracle Corp.	6,250	09.11.2032	07.11.2022	998	1.062	0,24
				$ 3.198	$ 3.363	0,76

Wertpapier mit einem gesamten beizulegenden Zeitwert von null USD (31. Dezember 2022: 12.732 USD) wurde zum 30. Juni 2023 gemäß den Rahmenverträgen für Wertpapier-Termingeschäfte für verzögert gelieferte Wertpapiere oder Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte als Sicherheit verpfändet oder geliefert.

Barmittel in Höhe von 11.254 USD (31. Dezember 2022: 11.785 USD) wurden zum 30. Juni 2023 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Barmittel in Höhe von 350 USD (31. Dezember 2022: 830 USD) wurden zum 30. Juni 2023 gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. als Sicherheit für Finanzderivate verpfändet.

Beizulegender Zeitwert[1]

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 30. Juni 2023 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie[2]	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	$ 696	$ 383.449	$ 562	$ 384.707
Investmentfonds	43.534	0	0	43.534
Pensionsgeschäfte	0	25.268	0	25.268
Finanzderivate[3]	6	4.944	0	4.950
Summen	**$ 44.236**	**$ 413.661**	**$ 562**	**$ 458.459**

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 31. Dezember 2022 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie[2]	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	$ 672	$ 345.328	$ 399	$ 346.399
Investmentfonds	38.657	0	0	38.657
Pensionsgeschäfte	0	15.383	0	15.383
Finanzderivate[3]	587	303	0	890
Leerverkaufte Wertpapiere	0	(2.035)	0	(2.035)
Summen	**$ 39.916**	**$ 358.979**	**$ 399**	**$ 399.294**

(1) Weitere Informationen finden Sie in den Erläuterungen in Erläuterung 3.

(2) Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung des Wertpapierbestands.

(3) Finanzderivate können offene Terminkontrakte, Swap-, Verkaufs- oder Kaufoptionen sowie Devisenterminkontrakte enthalten.

Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC-Finanzderivate und -Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2023 und 31. Dezember 2022:

	Zum 30. Jun. 2023			Zum 31. Dez. 2022		
Kontrahent	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-engagement[1]	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Nettoengagement[1]
AZD	$ 10	$ 0	$ 10	$ k. A.	$ k. A.	$ k. A.
BOA	596	(570)	26	(108)	0	(108)
BPS	722	(670)	52	(856)	740	(116)
BRC	102	0	102	14	0	14
BSH	2	0	2	k. A.	k. A.	k. A.
CBK	(131)	0	(131)	988	(750)	238
CLY	(20)	0	(20)	(36)	0	(36)
DUB	(200)	260	60	(1)	0	(1)
FBF	k. A.	k. A.	k. A.	8	0	8
GLM	15	0	15	138	0	138
GST	16	0	16	23	0	23
JPM	748	(620)	128	240	(170)	70
MYC	(12)	90	78	(71)	90	19
MYI	186	(30)	156	(5)	(10)	(15)
RYL	k. A.	k. A.	k. A.	294	0	294
SAL	(4)	0	(4)	(3)	0	(3)
SCX	312	(290)	22	979	(930)	49
SSB	18	0	18	45	0	45

[1] Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären.

Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung des Wertpapierbestands zum 30. Juni 2023:

	30. Jun. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	60,96	59,33
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	25,53	29,34
Sonstige übertragbare Wertpapiere	k. A.	0,48
Investmentfonds	9,79	9,95
Pensionsgeschäfte	5,68	3,96
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	0,11	0,18
Zentral abgerechnete Finanzderivate	0,47	(0,37)
Freiverkehrsfinanzderivate	0,53	0,42
Leerverkaufte Wertpapiere	k. A.	(0,52)
Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte	k. A.	(9,95)

Das Anlageportfolio des Fonds konzentriert sich zum 30. Juni 2023 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	30. Jun. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
Kreditbeteiligungen und -abtretung	0,11	1,26
Unternehmensanleihen und Wechsel	67,94	67,65
Kommunalanleihen und Wechsel	0,13	k. A.
US-Regierungsbehörden	5,74	5,09
US-Schatzobligationen	7,81	8,62
Non-Agency-MBS	0,31	0,26
Forderungsbesicherte Wertpapiere	0,67	0,52
Staatsemissionen	1,20	2,12
Stammaktien	0,00	0,00
Optionsscheine	0,00	0,00
Vorzugswertpapiere	0,16	0,17
Kurzfristige Instrumente	2,42	3,46
Investmentfonds	9,79	9,95
Pensionsgeschäfte	5,68	3,96
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	0,11	0,18
Verkaufsoptionen		
Optionen auf börsengehandelte Terminkontrakte	0,00	k. A.
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	0,05	(0,05)
Credit Default Swaps auf Kreditindizes— Schutzverkauf	0,16	(0,03)
Zinsswaps	0,26	(0,29)
Freiverkehrsfinanzderivate		
Optionskauf		
Zinsswapoptionen	k. A.	0,54
Verkaufsoptionen		
Credit Default Swaptions auf Kreditindizes	k. A.	0,00
Zinsswapoptionen	(0,01)	(0,96)
Optionen auf Wertpapiere	0,00	(0,01)
Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf	0,02	0,01
Credit Default Swaps auf Kreditindizes— Schutzverkauf	0,01	0,01
Devisenterminkontrakte	(0,05)	(0,06)
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	0,56	0,89
Leerverkaufte Wertpapiere	k. A.	(0,52)
Sonstige Aktiva und Passiva	(3,07)	(2,77)
Nettovermögen	100,00	100,00

BESCHREIBUNG		PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE				
AUSTRALIEN				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Ausgrid Finance Pty. Ltd.				
3,750 % fällig am 30.10.2024	AUD	4.690	$ 3.059	0,15
4,898 % fällig am 30.10.2024		6.100	4.068	0,20
ING Bank Australia Ltd.				
4,728 % fällig am 26.05.2025		10.200	6.800	0,33
Toyota Finance Australia Ltd.				
4,637 % fällig am 09.09.2024		2.000	1.322	0,06
4,867 % fällig am 26.03.2024		1.000	664	0,03
Transurban Queensland Finance Pty. Ltd.				
6,352 % fällig am 16.12.2024		1.570	1.058	0,05
Victoria Power Networks Finance Pty. Ltd.				
4,416 % fällig am 23.08.2024		3.000	1.985	0,10
Westpac Banking Corp.				
4,862 % fällig am 16.11.2023		20.000	13.337	0,64
Summe Australien			32.293	1,56
CAYMAN INSELN				
FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE				
Atlas Senior Loan Fund Ltd.				
6,120 % fällig am 20.04.2028	$	43	43	0,00
6,350 % fällig am 15.01.2031		4.057	4.005	0,19
Carlyle U.S. CLO Ltd.				
6,440 % fällig am 15.01.2030		1.137	1.127	0,06
Catamaran CLO Ltd.				
6,373 % fällig am 22.04.2030		1.411	1.403	0,07
CBAM Ltd.				
6,280 % fällig am 17.04.2031		3.050	3.014	0,15
6,370 % fällig am 20.10.2029		7.668	7.620	0,37
CIFC Funding Ltd.				
6,323 % fällig am 24.04.2030		12.816	12.747	0,62
Crestline Denali CLO Ltd.				
6,370 % fällig am 20.01.2030		4.932	4.866	0,24
Dryden CLO Ltd.				
6,310 % fällig am 15.07.2031		650	645	0,03
Dryden Senior Loan Fund				
6,160 % fällig am 15.04.2029		503	500	0,02
Elevation CLO Ltd.				
6,478 % fällig am 15.10.2029		4.698	4.695	0,23
6,540 % fällig am 15.07.2029		1.918	1.911	0,09
Gallatin CLO Ltd.				
6,311 % fällig am 21.01.2028		1.227	1.226	0,06
Greenwood Park CLO Ltd.				
6,270 % fällig am 15.04.2031		7.730	7.619	0,37
LCM LP				
6,290 % fällig am 20.10.2027		1.067	1.068	0,05
Nassau Ltd.				
6,410 % fällig am 15.10.2029		575	574	0,03
Neuberger Berman Loan Advisers CLO Ltd.				
6,395 % fällig am 19.10.2031		20.250	20.082	0,97
Octagon Investment Partners Ltd.				
6,220 % fällig am 16.04.2031		300	297	0,02
6,230 % fällig am 15.04.2031		500	496	0,02
Octagon Loan Funding Ltd.				
6,525 % fällig am 18.11.2031		5.640	5.588	0,27
OZLM Ltd.				
6,280 % fällig am 15.04.2031		1.300	1.281	0,06
6,330 % fällig am 17.01.2031		2.269	2.245	0,11
6,400 % fällig am 20.01.2031		477	472	0,02
Palmer Square CLO Ltd.				
6,390 % fällig am 17.01.2031		1.076	1.069	0,05
Sound Point CLO Ltd.				
6,412 % fällig am 18.04.2031		4.600	4.520	0,22
Steele Creek CLO Ltd.				
6,331 % fällig am 21.04.2031		2.957	2.937	0,14
Tralee CLO Ltd.				
6,570 % fällig am 20.07.2029		688	687	0,03
Venture CLO Ltd.				
6,140 % fällig am 15.04.2027		4.417	4.403	0,21
6,311 % fällig am 07.09.2030		1.495	1.483	0,07
6,350 % fällig am 20.01.2029		4.894	4.860	0,24
			103.483	5,01

BESCHREIBUNG		PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Avolon Holdings Funding Ltd.				
2,875 % fällig am 15.02.2025	$	2.500	$ 2.327	0,11
5,125 % fällig am 01.10.2023		3.800	3.785	0,18
Park Aerospace Holdings Ltd.				
5,500 % fällig am 15.02.2024		1.800	1.780	0,09
QNB Finance Ltd.				
1,125 % fällig am 17.06.2024		32.100	30.668	1,48
			38.560	1,86
Summe Cayman Inseln			142.043	6,87
DÄNEMARK				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Danske Bank A/S				
3,773 % fällig am 28.03.2025		500	489	0,02
FINNLAND				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Nordea Bank Abp				
6,050 % fällig am 06.06.2025		2.700	2.706	0,13
FRANKREICH				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
BNP Paribas S.A.				
3,375 % fällig am 09.01.2025		9.100	8.745	0,42
4,705 % fällig am 10.01.2025		8.500	8.426	0,41
5,708 % fällig am 28.02.2024	AUD	1.800	1.200	0,06
BPCE S.A.				
4,000 % fällig am 12.09.2023	$	1.175	1.170	0,05
Societe Generale S.A.				
2,625 % fällig am 22.01.2025		11.600	10.906	0,53
4,250 % fällig am 14.09.2023		2.700	2.687	0,13
6,096 % fällig am 21.01.2026		8.975	8.893	0,43
Summe Frankreich			42.027	2,03
DEUTSCHLAND				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Deutsche Bank AG				
0,898 % fällig am 28.05.2024 (f)		5.609	5.331	0,26
0,962 % fällig am 08.11.2023		5.500	5.390	0,26
3,700 % fällig am 30.05.2024		8.200	7.964	0,38
5,589 % fällig am 08.11.2023		2.000	1.996	0,10
Summe Deutschland			20.681	1,00
IRLAND				
FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE				
Black Diamond CLO DAC				
4,303 % fällig am 15.05.2032	€	5.500	5.871	0,28
BNPP AM Euro CLO DAC				
3,777 % fällig am 15.04.2031		2.000	2.134	0,10
Cairn CLO DAC				
4,212 % fällig am 20.10.2028		16	17	0,00
Carlyle Euro CLO DAC				
3,877 % fällig am 15.01.2031		19.911	21.267	1,03
Contego CLO DAC				
3,851 % fällig am 23.01.2030		13.464	14.399	0,70
Harvest CLO DAC				
4,250 % fällig am 26.06.2030		8.330	8.906	0,43
Oak Hill European Credit Partners DAC				
3,940 % fällig am 20.10.2031		1.400	1.487	0,07
Palmer Square European Loan Funding DAC				
3,907 % fällig am 15.07.2031		4.201	4.476	0,22
3,957 % fällig am 15.04.2031		5.771	6.185	0,30
Tikehau CLO DAC				
4,144 % fällig am 04.08.2034		15.000	15.991	0,77
Voya Euro CLO DAC				
3,927 % fällig am 15.10.2030		10.568	11.384	0,55
			92.117	4,45
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
AerCap Ireland Capital DAC				
1,150 % fällig am 29.10.2023	$	10.000	9.841	0,48
4,875 % fällig am 16.01.2024		1.812	1.800	0,09

BESCHREIBUNG		PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
SMBC Aviation Capital Finance DAC				
3,550 % fällig am 15.04.2024	$	6.800	$ 6.659	0,32
4,125 % fällig am 15.07.2023		5.200	5.196	0,25
			23.496	1,14
Summe Irland			115.613	5,59
ISRAEL				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Israel Electric Corp. Ltd.				
5,000 % fällig am 12.11.2024		8.900	8.810	0,43
STAATSEMISSIONEN				
Israel Government International Bond				
1,500 % fällig am 30.11.2023	ILS	9.600	2.554	0,12
Summe Israel			11.364	0,55
JAPAN				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Aozora Bank Ltd.				
1,050 % fällig am 09.09.2024	$	26.300	24.676	1,19
Mitsubishi HC Capital, Inc.				
3,960 % fällig am 19.09.2023		3.200	3.184	0,15
Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc.				
0,848 % fällig am 15.09.2024		4.000	3.956	0,19
6,475 % fällig am 12.09.2025		10.000	10.058	0,49
6,682 % fällig am 18.07.2025		9.100	9.172	0,44
Mizuho Financial Group, Inc.				
0,849 % fällig am 08.09.2024		1.800	1.782	0,09
1,241 % fällig am 10.07.2024		1.200	1.199	0,06
3,922 % fällig am 11.09.2024		6.300	6.271	0,30
6,201 % fällig am 10.07.2024		4.000	4.000	0,19
Nissan Motor Co. Ltd.				
3,043 % fällig am 15.09.2023		18.800	18.669	0,90
Nomura Holdings, Inc.				
1,851 % fällig am 16.07.2025		14.800	13.543	0,66
2,648 % fällig am 16.01.2025		4.300	4.073	0,20
Panasonic Holdings Corp.				
2,679 % fällig am 19.07.2024		1.000	966	0,05
Renesas Electronics Corp.				
1,543 % fällig am 26.11.2024		1.485	1.388	0,07
Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc.				
4,911 % fällig am 16.10.2024	AUD	9.700	6.452	0,31
6,439 % fällig am 13.01.2026	$	9.700	9.782	0,47
Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd.				
0,850 % fällig am 25.03.2024		1.000	965	0,05
Summe Japan			120.136	5,81
MULTINATIONAL				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Broadcom Corp.				
3,625 % fällig am 15.01.2024		2.500	2.471	0,12
NIEDERLANDE				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Enel Finance International NV				
2,650 % fällig am 10.09.2024		11.990	11.541	0,56
4,250 % fällig am 15.06.2025		4.310	4.185	0,20
6,800 % fällig am 14.10.2025		3.600	3.668	0,18
ING Groep NV				
6,102 % fällig am 01.04.2027		5.000	4.958	0,24
6,732 % fällig am 28.03.2026		13.100	13.182	0,64
JDE Peet's NV				
0,800 % fällig am 24.09.2024		9.955	9.340	0,45
LeasePlan Corp. NV				
2,875 % fällig am 24.10.2024		3.325	3.169	0,15
Vonovia Finance BV				
5,000 % fällig am 02.10.2023		1.596	1.588	0,08
Summe Niederlande			51.631	2,50
NORWEGEN				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
DNB Bank ASA				
2,968 % fällig am 28.03.2025		2.700	2.637	0,13

BESCHREIBUNG		PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
KATAR				
KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG				
Qatar National Bank QPSC				
5,966 % fällig am 10.10.2023	$	900	$ 900	0,04
SAUDI-ARABIEN				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Saudi Arabian Oil Co.				
1,625 % fällig am 24.11.2025		2.200	2.013	0,10
SINGAPUR				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Aviation Ltd.				
6,667 % fällig am 26.09.2023		1.700	1.700	0,08
SÜDKOREA				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Korea Southern Power Co. Ltd.				
4,648 % fällig am 30.10.2024	AUD	5.300	3.520	0,17
SK Hynix, Inc.				
1,000 % fällig am 19.01.2024	$	12.804	12.447	0,60
3,000 % fällig am 17.09.2024		600	576	0,03
			16.543	0,80
STAATSEMISSIONEN				
Korea Development Bank				
0,500 % fällig am 27.10.2023		500	491	0,03
Summe Südkorea			17.034	0,83
SPANIEN				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Santander S.A.				
3,892 % fällig am 24.05.2024		7.900	7.748	0,38
5,770 % fällig am 30.06.2024		6.900	6.863	0,33
Summe Spanien			14.611	0,71
PRANATIONAL				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
ionale Bank für Wiederaufbau und Entwicklung				
0,650 % fällig am 10.02.2026		10.000	9.021	0,44
SCHWEIZ				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Credit Suisse AG				
5,464 % fällig am 02.02.2024		2.000	1.985	0,10
UBS AG				
4,548 % fällig am 30.07.2025	AUD	7.225	4.791	0,23
UBS Group AG				
6,669 % fällig am 12.05.2026	$	15.000	15.078	0,73
Summe Schweiz			21.854	1,06
VEREINIGTE ARABISCHE EMIRATE				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
First Abu Dhabi Bank PJSC				
5,019 % fällig am 18.02.2025	AUD	1.040	690	0,03
GROSSBRITANNIEN				
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
Barclays PLC				
1,007 % fällig am 10.12.2024	$	3.000	2.925	0,14
3,932 % fällig am 07.05.2025		12.800	12.513	0,61
6,467 % fällig am 26.06.2024	AUD	2.750	1.845	0,09
HSBC Bank PLC				
3,641 % fällig am 28.09.2024	$	2.200	2.164	0,10
HSBC Holdings PLC				
6,770 % fällig am 11.03.2025		15.500	15.564	0,75
6,920 % fällig am 12.09.2026		2.820	2.840	0,14
Imperial Brands Finance PLC				
3,125 % fällig am 26.07.2024		13.600	13.145	0,64
Lloyds Banking Group PLC				
5,579 % fällig am 07.03.2025	AUD	2.360	1.563	0,08

BESCHREIBUNG		PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
Nationwide Building Society				
0,550 % fällig am 22.01.2024	$	560	$ 544	0,03
4,363 % fällig am 01.08.2024		10.535	10.514	0,51
NatWest Group PLC				
4,269 % fällig am 22.03.2025		5.000	4.913	0,24
NatWest Markets PLC				
6,541 % fällig am 22.03.2025		8.900	8.942	0,43
Santander UK Group Holdings PLC				
4,796 % fällig am 15.11.2024		2.800	2.779	0,13
Standard Chartered PLC				
6,021 % fällig am 23.11.2025		9.100	9.028	0,44
6,832 % fällig am 30.03.2026		12.000	12.090	0,58
			101.369	4,91
NON-AGENCY-MBS				
Avon Finance PLC				
5,809 % fällig am 20.09.2048	£	9.822	12.484	0,60
Canada Square Funding PLC				
5,682 % fällig am 17.06.2058		5.605	7.087	0,34
Eurohome UK Mortgages PLC				
5,137 % fällig am 15.06.2044		276	337	0,02
Great Hall Mortgages PLC				
5,172 % fällig am 18.06.2038		17	22	0,00
Lanebrook Mortgage Transaction PLC				
5,965 % fällig am 12.06.2057		3.490	4.443	0,21
Precise Mortgage Funding PLC				
5,657 % fällig am 16.10.2056		1.606	2.039	0,10
6,004 % fällig am 12.03.2055		254	323	0,01
Residential Mortgage Securities PLC				
6,159 % fällig am 20.06.2070		119	152	0,01
Stratton Mortgage Funding PLC				
5,391 % fällig am 20.07.2060		15.067	19.158	0,93
5,765 % fällig am 12.03.2052		4.085	5.175	0,25
5,792 % fällig am 25.09.2051		5.472	6.941	0,34
Towd Point Mortgage Funding PLC				
5,635 % fällig am 20.10.2051		626	797	0,04
5,841 % fällig am 20.07.2045		4.525	5.755	0,28
Tudor Rose Mortgages				
5,509 % fällig am 20.06.2048		3.973	5.023	0,24
			69.736	3,37
Summe Großbritannien			171.105	8,28
USA				
FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE				
Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust				
5,183 % fällig am 25.03.2034	$	20	19	0,00
6,275 % fällig am 25.03.2035		335	331	0,02
CIT Mortgage Loan Trust				
6,500 % fällig am 25.10.2037		780	779	0,04
College Avenue Student Loans LLC				
6,800 % fällig am 26.11.2046		942	941	0,05
Commonbond Student Loan Trust				
2,730 % fällig am 25.10.2040		384	352	0,02
Countrywide Asset-Backed Certificates Trust				
5,705 % fällig am 25.06.2036		80	80	0,00
6,650 % fällig am 25.10.2034		648	637	0,03
EFS Volunteer LLC				
6,105 % fällig am 25.10.2035		92	92	0,00
EquiFirst Mortgage Loan Trust				
8,150 % fällig am 25.10.2034		582	545	0,03
Finance America Mortgage Loan Trust				
5,975 % fällig am 25.08.2034		759	704	0,03
First NLC Trust				
5,220 % fällig am 25.08.2037		230	118	0,01
Fremont Home Loan Trust				
5,885 % fällig am 25.01.2035		247	238	0,01
Home Equity Asset Trust				
6,095 % fällig am 25.06.2034		541	531	0,03
Long Beach Mortgage Loan Trust				
6,125 % fällig am 25.04.2035		1.078	1.063	0,05
MASTR Asset-Backed Securities Trust				
5,850 % fällig am 25.09.2034		838	710	0,03
Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust				
6,200 % fällig am 25.09.2033		609	600	0,03

BESCHREIBUNG		PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
Navient Private Education Loan Trust				
2,650 % fällig am 15.12.2028	$	39	$ 39	0,00
5,913 % fällig am 15.12.2059		3.681	3.644	0,18
6,643 % fällig am 16.07.2040		2.579	2.575	0,12
6,793 % fällig am 15.10.2031		6.953	6.946	0,34
7,343 % fällig am 15.12.2045		429	431	0,02
Navient Student Loan Trust				
6,893 % fällig am 15.11.2030		7.700	7.721	0,37
Nelnet Student Loan Trust				
5,750 % fällig am 27.02.2051		968	956	0,05
NovaStar Mortgage Funding Trust				
5,810 % fällig am 25.01.2036		781	768	0,04
RAAC Trust				
7,250 % fällig am 25.05.2044		1.336	1.289	0,06
SBA Tower Trust				
3,869 % fällig am 15.10.2049		3.000	2.909	0,14
SLC Student Loan Trust				
5,381 % fällig am 15.05.2029		835	830	0,04
SLM Private Credit Student Loan Trust				
5,842 % fällig am 15.06.2039		6.175	5.858	0,28
5,882 % fällig am 15.06.2039		5.722	5.499	0,27
SLM Student Loan Trust				
5,800 % fällig am 27.12.2038		1.073	1.045	0,05
5,855 % fällig am 25.10.2029		1.180	1.170	0,06
6,155 % fällig am 25.07.2023		710	697	0,03
6,955 % fällig am 25.07.2023		163	163	0,01
SMB Private Education Loan Trust				
5,943 % fällig am 15.10.2035		1.995	1.976	0,10
5,943 % fällig am 15.11.2035		1.699	1.679	0,08
6,643 % fällig am 17.02.2032		76	75	0,00
SoFi Professional Loan Program LLC				
2,650 % fällig am 25.09.2040		2.360	2.248	0,11
Structured Asset Investment Loan Trust				
5,700 % fällig am 25.09.2034		1.660	1.547	0,07
Wells Fargo Home Equity Asset-Backed Securities Trust				
6,875 % fällig am 25.11.2035		1.775	1.748	0,08
			59.553	2,88
UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL				
American Tower Corp.				
3,375 % fällig am 15.05.2024		9.000	8.814	0,43
4,000 % fällig am 01.06.2025		3.300	3.189	0,15
Athene Global Funding				
0,950 % fällig am 08.01.2024		2.300	2.232	0,11
1,200 % fällig am 13.10.2023		2.920	2.874	0,14
2,514 % fällig am 08.03.2024		1.300	1.265	0,06
5,790 % fällig am 24.05.2024		14.200	14.065	0,68
5,941 % fällig am 08.01.2024		2.084	2.076	0,10
Bank of America Corp.				
0,976 % fällig am 22.04.2025		12.500	11.988	0,58
3,864 % fällig am 23.07.2024		2.118	2.115	0,10
6,422 % fällig am 02.04.2026		4.400	4.439	0,21
Baxter International, Inc.				
5,351 % fällig am 01.12.2023		4.533	4.523	0,22
Bayer U.S. Finance LLC				
6,562 % fällig am 15.12.2023		11.825	11.813	0,57
Berry Global, Inc.				
4,875 % fällig am 15.07.2026		7.450	7.168	0,35
BGC Partners, Inc.				
5,375 % fällig am 24.07.2023		5.044	5.041	0,24
BOC Aviation USA Corp.				
1,625 % fällig am 29.04.2024		300	290	0,01
Brighthouse Financial Global Funding				
5,780 % fällig am 12.04.2024		400	397	0,02
Cantor Fitzgerald LP				
4,875 % fällig am 01.05.2024		10.950	10.716	0,52
Capital One Financial Corp.				
6,439 % fällig am 09.05.2025		2.000	1.977	0,10
Charter Communications Operating LLC				
6,949 % fällig am 01.02.2024		31.210	31.345	1,53
Citigroup, Inc.				
4,140 % fällig am 24.05.2025		2.000	1.966	0,10
5,379 % fällig am 27.10.2023	AUD	1.631	1.088	0,05
CNH Industrial Capital LLC				
1,950 % fällig am 02.07.2023	$	7.007	7.007	0,34

BESCHREIBUNG		PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
Daimler Truck Finance North America LLC				
1,125 % fällig am 14.12.2023	$	4.700	$ 4.603	0,22
5,841 % fällig am 13.12.2024		2.300	2.297	0,11
Energy Transfer LP				
4,250 % fällig am 01.04.2024		5.000	4.924	0,24
4,500 % fällig am 15.04.2024		3.000	2.966	0,14
5,875 % fällig am 15.01.2024		2.000	2.001	0,10
Five Corners Funding Trust				
4,419 % fällig am 15.11.2023		2.300	2.275	0,11
Fox Corp.				
4,030 % fällig am 25.01.2024		1.500	1.485	0,07
FS KKR Capital Corp.				
1,650 % fällig am 12.10.2024		2.000	1.861	0,09
GA Global Funding Trust				
0,800 % fällig am 13.09.2024		300	279	0,01
1,000 % fällig am 08.04.2024		2.800	2.671	0,13
1,250 % fällig am 08.12.2023		1.500	1.465	0,07
1,625 % fällig am 15.01.2026		3.500	3.107	0,15
5,591 % fällig am 13.09.2024		500	490	0,02
6,380 % fällig am 11.04.2025		3.000	2.939	0,14
General Motors Financial Co., Inc.				
1,700 % fällig am 18.08.2023		4.918	4.893	0,24
6,290 % fällig am 17.11.2023		8.000	8.006	0,39
Goldman Sachs Group, Inc.				
1,757 % fällig am 24.01.2025		13.100	12.758	0,62
5,236 % fällig am 02.05.2024	AUD	3.000	2.001	0,10
5,880 % fällig am 09.12.2026		4.300	4.267	0,21
HCA, Inc.				
5,000 % fällig am 15.03.2024		24.235	24.086	1,17
Jackson National Life Global Funding				
6,242 % fällig am 28.06.2024		8.200	8.212	0,40
JPMorgan Chase & Co.				
3,797 % fällig am 23.07.2024		500	499	0,02
4,023 % fällig am 05.12.2024		10.000	9.915	0,48
Kinder Morgan, Inc.				
5,625 % fällig am 15.11.2023		3.000	2.999	0,14
Midwest Connector Capital Co. LLC				
3,900 % fällig am 01.04.2024		1.600	1.567	0,08
Morgan Stanley				
0,790 % fällig am 30.05.2025		21.500	20.431	0,99
Nissan Motor Acceptance Co. LLC				
3,875 % fällig am 21.09.2023		1.000	995	0,05
Pacific Gas & Electric Co.				
1,700 % fällig am 15.11.2023		5.700	5.603	0,27
3,250 % fällig am 16.02.2024		2.000	1.964	0,09
3,400 % fällig am 15.08.2024 ^		500	484	0,02
3,750 % fällig am 15.02.2024 ^		1.700	1.672	0,08
3,850 % fällig am 15.11.2023 ^		300	297	0,01
Pacific Life Global Funding				
5,890 % fällig am 06.12.2024		400	398	0,02
Piper Sandler Cos.				
5,200 % fällig am 15.10.2023		3.500	3.491	0,17
Sabine Pass Liquefaction LLC				
5,750 % fällig am 15.05.2024		7.500	7.489	0,36
Southern California Edison Co.				
5,922 % fällig am 01.04.2024		4.500	4.494	0,22
Synchrony Financial				
4,250 % fällig am 15.08.2024		3.400	3.279	0,16
4,375 % fällig am 19.03.2024		4.900	4.806	0,23
TD SYNNEX Corp.				
1,250 % fällig am 09.08.2024		8.000	7.570	0,37
Verizon Communications, Inc.				
6,421 % fällig am 15.05.2025		8.221	8.292	0,40
VMware, Inc.				
0,600 % fällig am 15.08.2023		500	497	0,02
Volkswagen Group of America Finance LLC				
3,950 % fällig am 06.06.2025		15.700	15.251	0,74
Warnermedia Holdings, Inc.				
3,788 % fällig am 15.03.2025		3.000	2.894	0,14
Wells Fargo & Co.				
6,372 % fällig am 25.04.2026		2.000	2.015	0,10
			340.876	16,50
KOMMUNALANLEIHEN UND WECHSEL				
Pennsylvania Higher Education Assistance Agency Revenue Bonds, (GTD STD LNS Insured), Series 2006				
5,385 % fällig am 25.10.2036		589	586	0,03

BESCHREIBUNG		PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
NON-AGENCY-MBS				
American Home Mortgage Investment Trust				
5,750 % fällig am 25.09.2045	$	1.610	$ 1.420	0,07
Ashford Hospitality Trust				
6,219 % fällig am 15.04.2035		989	967	0,05
Atrium Hotel Portfolio Trust				
6,393 % fällig am 15.06.2035		11.300	11.056	0,54
Barclays Commercial Mortgage Securities Trust				
6,193 % fällig am 15.07.2037		900	881	0,04
Bear Stearns Adjustable Rate Mortgage Trust				
4,411 % fällig am 25.02.2036 ^		2	1	0,00
Bear Stearns ALT-A Trust				
4,202 % fällig am 25.09.2035 ^		13	8	0,00
BX Trust				
6,243 % fällig am 15.05.2035		2.775	2.744	0,13
Citigroup Commercial Mortgage Trust				
3,251 % fällig am 10.05.2035		1.027	954	0,05
Commercial Mortgage Trust				
3,178 % fällig am 10.02.2035		3.000	2.787	0,14
Credit Suisse Mortgage Capital Trust				
5,943 % fällig am 15.07.2032		1.305	1.244	0,06
DBCG Mortgage Trust				
5,894 % fällig am 15.06.2034		21.800	21.529	1,04
DBGS Mortgage Trust				
6,038 % fällig am 15.06.2033		2.600	2.422	0,12
DBWF Mortgage Trust				
6,276 % fällig am 19.12.2030		5.100	5.032	0,24
Deutsche Mortgage Securities, Inc. Re-REMIC Trust Certificates				
3,910 % fällig am 28.09.2036		1.074	1.074	0,05
GS Mortgage Securities Trust				
3,648 % fällig am 10.01.2047		77	76	0,00
GSR Mortgage Loan Trust				
3,966 % fällig am 25.11.2035 ^		97	81	0,00
4,234 % fällig am 25.06.2034		50	48	0,00
Impac CMB Trust				
5,790 % fällig am 25.03.2035		80	73	0,00
JPMorgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust				
4,128 % fällig am 05.07.2031		3.000	2.739	0,13
6,403 % fällig am 15.06.2035		2.229	2.071	0,10
Merrill Lynch Mortgage Investors Trust				
3,918 % fällig am 25.05.2033		146	140	0,01
7,119 % fällig am 25.03.2033		246	224	0,01
Mill City Mortgage Loan Trust				
2,750 % fällig am 25.07.2059		176	174	0,01
New Residential Mortgage Loan Trust				
3,500 % fällig am 25.12.2057		386	362	0,02
4,500 % fällig am 25.05.2058		180	172	0,01
Sequoia Mortgage Trust				
5,837 % fällig am 20.10.2034		435	386	0,02
Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust				
5,116 % fällig am 25.03.2034		9	8	0,00
Structured Asset Mortgage Investments Trust				
5,806 % fällig am 19.10.2034		309	290	0,01
Towd Point Mortgage Trust				
3,750 % fällig am 25.05.2058		8.192	7.733	0,38
WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust				
3,800 % fällig am 25.10.2035		244	221	0,01
5,610 % fällig am 25.04.2045		1	1	0,00
5,690 % fällig am 25.12.2045		29	28	0,00
Wells Fargo Commercial Mortgage Trust				
4,218 % fällig am 15.07.2046		74	74	0,00
			67.020	3,24
US-REGIERUNGSBEHÖRDEN				
Fannie Mae				
2,000 % fällig am 25.08.2038		5.296	4.736	0,23
3,166 % fällig am 25.08.2050		1.724	1.631	0,08
4,153 % fällig am 25.11.2047		2.817	2.746	0,13
4,366 % fällig am 01.10.2037		88	89	0,00
5,400 % fällig am 25.01.2037		32	32	0,00
5,460 % fällig am 25.04.2037		3	3	0,00
5,480 % fällig am 25.04.2037		7	7	0,00
5,500 % fällig am 25.07.2037		39	38	0,00
5,520 % fällig am 25.05.2037		26	26	0,00
5,540 % fällig am 25.04.2037		337	328	0,02

BESCHREIBUNG		PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
5,550 % fällig am 25.05.2037 - 25.10.2040	$	31	$ 30	0,00
5,570 % fällig am 25.05.2037		49	48	0,00
5,600 % fällig am 25.10.2030 - 25.06.2060		18.389	17.775	0,86
5,650 % fällig am 25.08.2037		48	47	0,00
5,700 % fällig am 25.12.2049		5	5	0,00
5,820 % fällig am 25.03.2038		54	54	0,00
5,830 % fällig am 25.12.2037		40	39	0,00
5,850 % fällig am 25.01.2041		64	63	0,00
6,150 % fällig am 25.05.2037		162	165	0,01
Federal Home Loan Bank				
5,500 % fällig am 08.05.2025		38.000	37.913	1,83
5,650 % fällig am 28.05.2025		21.000	20.974	1,02
5,710 % fällig am 14.03.2025		20.000	20.010	0,97
Freddie Mac				
0,000 % fällig am 15.01.2038 (a)		627	26	0,00
2,500 % fällig am 25.10.2048		751	666	0,03
3,000 % fällig am 25.09.2045		2.101	1.841	0,09
4,000 % fällig am 01.08.2048		1.450	1.385	0,07
4,282 % fällig am 15.08.2038		239	230	0,01
4,299 % fällig am 15.10.2040		6.698	6.436	0,31
4,348 % fällig am 15.01.2038		15.688	15.248	0,74
5,375 % fällig am 24.04.2025		10.000	9.954	0,48
5,376 % fällig am 25.07.2044		4	3	0,00
5,493 % fällig am 15.05.2037		44	43	0,00
5,520 % fällig am 28.05.2025		22.400	22.351	1,08
5,550 % fällig am 09.05.2025 - 25.07.2050		34.244	33.704	1,63
5,593 % fällig am 15.02.2034 - 15.08.2056		6.820	6.518	0,32
5,603 % fällig am 15.06.2037		545	534	0,03
5,643 % fällig am 15.10.2036 - 15.06.2042		44	43	0,00
5,673 % fällig am 15.10.2040		68	67	0,00
5,680 % fällig am 03.04.2025		21.000	20.974	1,02
5,693 % fällig am 15.11.2050		77	72	0,00
5,713 % fällig am 15.05.2036 - 15.12.2041		171	167	0,01
5,730 % fällig am 03.04.2025		21.000	20.986	1,02
5,800 % fällig am 03.07.2025 (b)		20.000	19.985	0,97
Ginnie Mae				
2,500 % fällig am 20.01.2049		729	643	0,03
2,625 % fällig am 20.08.2024		0	0	0,00
2,750 % fällig am 20.11.2029		2	2	0,00
3,625 % fällig am 20.03.2027 - 20.03.2030		22	20	0,00
3,689 % fällig am 20.12.2068		1.018	988	0,05
4,614 % fällig am 20.12.2065		827	817	0,04
4,770 % fällig am 20.01.2066		389	385	0,02
4,961 % fällig am 20.04.2067		3.257	3.239	0,16
5,099 % fällig am 20.09.2066		1.400	1.424	0,07
5,554 % fällig am 20.02.2067		597	593	0,03
5,646 % fällig am 20.10.2037		138	138	0,01
5,844 % fällig am 20.08.2067		1.944	1.931	0,09
5,944 % fällig am 20.11.2066		787	782	0,04
6,066 % fällig am 20.05.2073		4.307	4.313	0,21
6,166 % fällig am 20.05.2073		1.000	1.001	0,05
6,184 % fällig am 20.06.2071		7.114	7.272	0,35
6,986 % fällig am 20.05.2071		4.856	4.968	0,24
6,990 % fällig am 20.06.2071		5.103	5.210	0,25
Uniform Mortgage-Backed Security				
4,000 % fällig am 01.09.2049		3.687	3.512	0,17
			305.230	14,77
Summe USA			773.265	37,42
KURZFRISTIGE INSTRUMENTE				
COMMERCIAL PAPER				
Ameren Corp.				
5,400 % fällig am 24.07.2023		20.800	20.726	1,00
Global Payments, Inc.				
5,930 % fällig am 26.07.2023		1.000	996	0,05
5,930 % fällig am 28.07.2023		800	796	0,04
5,950 % fällig am 14.07.2023		2.500	2.494	0,12
Targa Resources Corp.				
5,950 % fällig am 20.07.2023		2.900	2.892	0,14
Virginia Electric & Power Co.				
5,330 % fällig am 13.07.2023		8.800	8.783	0,43
			36.687	1,78

BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
KURZFRISTIGE SCHULDTITEL			
Warnermedia Holdings, Inc.			
3,428 % fällig am 15.03.2024	$ 12.325	$ 12.104	0,59
3,528 % fällig am 15.03.2024	2.000	1.964	0,09
		14.068	0,68
JAPAN TREASURY BILLS			
(0,186) % fällig am 07.08.2023 (c)(d)	¥ 2.486.000	17.202	0,83
(0,166) % fällig am 07.08.2023 (c)(d)	424.000	2.934	0,14
		20.136	0,97

BESCHREIBUNG	PAR (000S)	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
U.S. TREASURY BILLS			
5,175 % fällig am 01.08.2023 (b)(c)(d)	$ 209.000	$ 208.149	10,07
5,304 % fällig am 29.08.2023 (b)(c)(d)	215.400	213.650	10,34
5,390 % fällig am 31.10.2023 (b)(c)(d)	128.900	126.690	6,13
		548.489	26,54
Summe kurzfristige Instrumente		619.380	29,97
Summe Übertragbare Wertpapiere		**$ 2.175.664**	**105,27**

BESCHREIBUNG	AKTIEN	MARKT-WERT (000S)	% DES NETTO-VERMÖ-GENS
INVESTMENTFONDS			
ORGANISMEN FÜR GEMEINSAME ANLAGEN			
PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (e)	6.321	$ 63	0,00
BÖRSENGEHANDELTE FONDS			
PIMCO ETFs plc - PIMCO US Dollar Short Maturity UCITS ETF (e)	2.082.187	206.824	10,00
Summe Investmentfonds		**$ 206.887**	**10,00**

PENSIONSGESCHÄFTE

Kontrahent	Kredit-zins	Abrechnungs-datum	Fälligkeits-datum	Kapital-betrag	Besichert durch	Sicherheiten (erhalten)	Pensions-geschäfte, zum Wert	Zu erhaltende Erlöse aus Pensions-geschäft[1]	% des Nettovermögens
BPS	5,100 %	30.06.2023	03.07.2023	$ 196.400	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,875 % fällig am 15.01.2029	$ (200.759)	$ 196.400	$ 196.483	9,51
	5,160	30.06.2023	03.07.2023	29.300	U.S. Treasury Notes 0,500 % fällig am 30.06.2027	(29.947)	29.300	29.313	1,42
FICC	2,400	30.06.2023	03.07.2023	2.237	U.S. Treasury Notes 4,625 % fällig am 30.06.2025	(2.282)	2.237	2.237	0,11
Summe Pensionsgeschäfte						**$ (232.988)**	**$ 227.937**	**$ 228.033**	**11,04**

(1) Umfasst aufgelaufene Zinsen.

AN EINEM GEREGELTEN MARKT GEHANDELTE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*, außer Anzahl der Kontrakte)

*** Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt**

FUTURES

Beschreibung	Art	Ablauf-monat	Anzahl der Kontrakte	Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
U.S. Treasury 2-Year Note September Futures	Short	09.2023	475	$ 895	0,04
U.S. Treasury 5-Year Note September Futures	Short	09.2023	941	1.026	0,05
U.S. Treasury 10-Year Note September Futures	Short	09.2023	61	118	0,01
U.S. Treasury 10-Year Ultra September Futures	Short	09.2023	79	107	0,01
U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond September Futures	Short	09.2023	14	(28)	(0,01)
				$ 2.118	0,10
Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate				**$ 2.118**	**0,10**

ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)

*** Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt**

CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZKAUF[1]

Index/Tranchen	Zu bezahlender Festzinssatz	Fälligkeits-datum	Nenn-betrag[2]	Nicht realisierte Wertzunahme (Wertabnahme)	% des Nettovermögen
CDX.IG-40 5-Year Index	(1,000) %	20.06.2028	$ 352.200	$ (2.593)	(0,13)
Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate				**$ (2.593)**	**(0,13)**

(1) Agiert der Fonds als Käufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann erhält der Fonds entweder (i) vom Sicherungsgeber einen Betrag in Höhe des Nennwerts des Swaps und liefert die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er erhält einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.

(2) Der maximal mögliche Betrag, den der Fonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

DERIVATIVE OTC-FINANZINSTRUMENTE (Beträge in Tausend*, außer Anzahl der Kontrakte)

*** Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt**

DEVISENTERMINKONTRAKTE

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung		Zu erhaltende Währung		Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2023	¥	1.100	$	8	$ 0	$ 0	$ 0	0,00
	07.2023	$	2.259	CAD	2.988	0	(1)	(1)	0,00
	07.2023		4.890	£	3.867	26	0	26	0,00
	08.2023	AUD	88.451	$	59.791	843	0	843	0,04
	08.2023	$	3.285	AUD	5.017	58	0	58	0,00
	02.2024	CAD	1.000	$	747	0	(12)	(12)	0,00
BPS	07.2023	€	85.239		91.633	0	(1.363)	(1.363)	(0,06)
	07.2023	$	93.258	€	85.113	0	(400)	(400)	(0,02)
	08.2023	€	85.113	$	93.389	404	0	404	0,02
BRC	09.2023	$	20	ILS	71	0	(1)	(1)	0,00
CBK	07.2023	€	8.437	$	9.054	0	(151)	(151)	(0,01)
	11.2023	ILS	9.434		2.738	179	0	179	0,01
DUB	02.2024	CAD	2.000		1.493	0	(23)	(23)	0,00
JPM	07.2023	$	9.156	€	8.563	187	0	187	0,01
	07.2023		3	¥	374	0	0	0	0,00
	08.2023	¥	373	$	3	0	0	0	0,00
	09.2023	$	19	ILS	69	0	(1)	(1)	0,00
MBC	07.2023	CAD	31	$	23	0	0	0	0,00
	07.2023	£	60.641		75.065	0	(2.031)	(2.031)	(0,10)
MYI	07.2023	€	386		421	0	0	0	0,00
	07.2023	$	1.114	£	875	0	(2)	(2)	0,00
RBC	07.2023	MXN	60	$	3	0	0	0	0,00
	08.2023	$	18	MXN	319	0	0	0	0,00
TOR	07.2023	CAD	2.096	$	1.579	0	(5)	(5)	0,00
	07.2023	$	71.032	£	55.899	36	0	36	0,00
	08.2023	£	54.974	$	69.871	0	(35)	(35)	0,00
	08.2023	$	1.579	CAD	2.095	5	0	5	0,00
UAG	08.2023	¥	2.910.000	$	21.468	1.234	0	1.234	0,05
	09.2023	$	17	ILS	59	0	(1)	(1)	0,00
						$ 2.972	$ (4.026)	$ (1.054)	(0,06)

ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklassen Institutional EUR (Hedged) thesaurierend und Class E EUR (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung		Zu erhaltende Währung		Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
BOA	07.2023	€	25	$	27	$ 0	$ 0	$ 0	0,00
	07.2023	$	54.383	€	50.602	824	0	824	0,04
BPS	07.2023	€	45.378	$	49.721	213	0	213	0,01
	07.2023	$	504	€	461	0	(1)	(1)	0,00
	08.2023		49.782		45.370	0	(216)	(216)	(0,01)
BRC	07.2023	€	8.563	$	9.159	0	(183)	(183)	(0,01)
CBK	07.2023		51.552		56.088	17	(173)	(156)	(0,01)
	07.2023	$	192	€	179	3	0	3	0,00
	08.2023		49.640		45.594	171	0	171	0,01
GLM	07.2023		4.929		4.614	106	0	106	0,01
MBC	07.2023	€	508	$	545	0	(9)	(9)	0,00
	07.2023	$	51.138	€	47.842	1.058	0	1.058	0,05
SCX	07.2023		51.137		47.784	995	0	995	0,05
						$ 3.387	$ (582)	$ 2.805	0,14

Zum 30. Juni 2023 standen für die Anteilsklasse Institutional GBP (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

Kontrahent	Abrechnungs-monat	Zu zahlende Währung		Zu erhaltende Währung		Nicht realisierte Wertzunahme	Nicht realisierte (Wertabnahme)	Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme)	% des Nettovermögens
CBK	07.2023	$	83	£	67	$ 1	$ 0	$ 1	0,00
RBC	07.2023		83		67	2	0	2	0,00
SCX	07.2023		83		67	2	0	2	0,00
						$ 5	$ 0	$ 5	0,00

Summe Freiverkehrsfinanzderivate	**$ 1.756**	**0,08**
Summe Anlagen	**$ 2.611.769**	**126,36**
Sonstige Aktiva und Passiva	**$ (544.865)**	**(26,36)**
Nettovermögen	**$ 2.066.904**	**100,00**

ERLÄUTERUNGEN ZUR AUFSTELLUNG DES WERTPAPIERBESTANDS (Angaben in Tausend*):

*** Auf Null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt.**

^ Das Wertpapier ist in Verzug.

(a) Bei dem Wertpapier handelt es sich um ein Interest Only- („IO“) bzw. IO-Strip.

(b) Wertpapier per Emissionstermin.

(c) Nullkuponwertpapier.

(d) Der Kupon stellt eine Rendite bis zur Endfälligkeit dar.

(e) Mit dem Fonds verbunden.

(f) Eingeschränkte Wertpapiere (31. Dezember 2022: 0,32 %):

Emittentenbeschreibung	Kupon	Fälligkeits-datum	Kauf-datum	Kosten	Markt-wert	% des Nettovermögens
Deutsche Bank AG	0,898 %	28.03.2024	31.03.2023 - 31.05.2023	$ 5.382	$ 5.331	0,26

Barmittel in Höhe von 11.983 USD (31. Dezember 2022: 16.350 USD) wurden zum 30. Juni 2023 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Barmittel in Höhe von 1.820 USD (31. Dezember 2022: 1.780 USD) wurden zum 30. Juni 2023 gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. als Sicherheit für Finanzderivate verpfändet.

Beizulegender Zeitwert[1]

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 30. Juni 2023 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie[2]	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	$ 0	$ 2.174.512	$ 1.152	$ 2.175.664
Investmentfonds	206.887	0	0	206.887
Pensionsgeschäfte	0	227.937	0	227.937
Finanzderivate[3]	0	1.281	0	1.281
Summen	**$ 206.887**	**$ 2.403.730**	**$ 1.152**	**$ 2.611.769**

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Fonds zum 31. Dezember 2022 verwendeten Inputfaktoren:

Kategorie[2]	An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1)	Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2)	Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3)	Marktwert
Übertragbare Wertpapiere	$ 0	$ 1.891.711	$ 0	$ 1.891.711
Investmentfonds	62	225.956	0	226.018
Pensionsgeschäfte	0	154.472	0	154.472
Finanzderivate[3]	0	4.760	0	4.760
Summen	**$ 62**	**$ 2.276.899**	**$ 0**	**$ 2.276.961**

(1) Weitere Informationen finden Sie in den Erläuterungen in Erläuterung 3.

(2) Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung des Wertpapierbestands.

(3) Finanzderivate können offene Terminkontrakte, Swap-, Verkaufs- oder Kaufoptionen sowie Devisenterminkontrakte enthalten.

Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC-Finanzderivate und -Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2023 und 31. Dezember 2022:

	Zum 30. Jun. 2023			Zum 31. Dez. 2022		
Kontrahent	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-Engagement[1]	Gesamtmarktwert der OTC-Derivate	Sicherheiten (erhalten)/verpfändet	Netto-Engagement[1]
AZD	$ k. A.	$ k. A.	$ k. A.	$ 1.566	$ (1.460)	$ 106
BOA	1.738	(1.790)	(52)	(2.159)	1.770	(389)
BPS	(1.363)	1.430	67	131	0	131
BRC	(184)	0	(184)	(17)	0	(17)
CBK	47	0	47	1.487	(1.350)	137
DUB	(23)	0	(23)	(4)	0	(4)
GLM	106	0	106	k. A.	k. A.	k. A.
JPM	186	(260)	(74)	350	(290)	60
MBC	(982)	390	(592)	(153)	0	(153)
MYI	(2)	(10)	(12)	(2)	10	8
RBC	2	0	2	k. A.	k. A.	k. A.
SCX	997	(1.050)	(53)	2.590	(2.250)	340
TOR	1	0	1	k. A.	k. A.	k. A.
UAG	1.233	(1.100)	133	(101)	0	(101)

(1) Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären.

Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung des Wertpapierbestands zum 30. Juni 2023:

	30. Jun. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere	38,73	43,64
An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere	66,54	38,19
Sonstige übertragbare Wertpapiere	k. A.	0,05
Investmentfonds	10,00	9,78
Pensionsgeschäfte	11,04	6,69
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	0,10	0,04
Zentral abgerechnete Finanzderivate	(0,13)	0,01
Freiverkehrsfinanzderivate	0,08	0,16

Das Anlageportfolio des Fonds konzentriert sich zum 30. Juni 2023 auf die folgenden Segmente:

Anlagen zum Marktwert	30. Jun. 2023 (%)	31. Dez. 2022 (%)
Australien	1,56	1,66
Belgien	k. A.	0,39
Bermuda	k. A.	0,39
Cayman Inseln	6,87	3,83
Dänemark	0,02	0,66
Finnland	0,13	0,38
Frankreich	2,03	2,56
Deutschland	1,00	1,17
Irland	5,59	5,43
Israel	0,55	0,35
Italien	k. A.	0,22
Japan	5,81	5,03
Luxemburg	k. A.	0,10
Multinational	0,12	k. A.
Niederlande	2,50	3,03
Norwegen	0,13	0,04
Katar	0,04	k. A.
Saudi-Arabien	0,10	0,11
Singapur	0,08	0,07
Südkorea	0,83	0,84
Spanien	0,71	0,42
Supranational	0,44	1,10
Schweiz	1,06	1,42
Vereinigte Arabische Emirate	0,03	0,08
Großbritannien	8,28	8,42
Vereinigte Staaten	37,42	42,70
Kurzfristige Instrumente	29,97	1,48
Investmentfonds	10,00	9,78
Pensionsgeschäfte	11,04	6,69
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
Futures	0,10	0,04
Zentral abgerechnete Finanzderivate		
Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzkauf	(0,13)	0,01
Zinsswaps — Basisswaps	k. A.	0,00
Freiverkehrsfinanzderivate		
Devisenterminkontrakte	(0,06)	(0,11)
Abgesicherte Devisenterminkontrakte	0,14	0,27
Sonstige Aktiva und Passiva	(26,36)	1,44
Nettovermögen	100,00	100,00

1. ALLGEMEINE INFORMATIONEN

Die einzelnen in diesem Bericht beschriebenen Fonds (nachfolgend jeweils als ein „Fonds“ und gemeinsam als die „Fonds“ bezeichnet) sind Teilfonds der PIMCO Funds: Global Investors Series plc (die „Gesellschaft“), einer offenen Investmentgesellschaft des Umbrella-Typs mit variablem Kapital und mit gesonderter Haftung zwischen den Fonds und mit beschränkter Haftung, die gemäß dem Companies Act von 2014 unter der Register-Nr. 276928 in Irland eingetragen und von der Zentralbank von Irland (die „Zentralbank“) nach den Rechtsvorschriften der Europäischen Gemeinschaften von 2011 (Organismen für die gemeinsame Anlage in übertragbaren Wertpapieren („OGAW“)) (Verordnung Nr. 352 von 2011) in der jeweils geltenden Fassung (die „OGAW-Richtlinien“) genehmigt wurde. Bei der Gesellschaft handelt es sich um eine Umbrella-Gesellschaft, die aus verschiedenen Fonds besteht, die jeweils eine oder mehrere Anteilsklassen („Klassen“) umfassen. Nach dem Ermessen des Verwaltungsrats (der „Verwaltungsrat“ oder die „Verwaltungsratsmitglieder“) dürfen für einen Fonds mehrere Anteilsklassen („Klassen“) ausgegeben werden. Für jeden einzelnen Fonds wird ein gesondertes Vermögenswertportfolio geführt, welches in Übereinstimmung mit den Anlagezielen und der Anlagepolitik, die auf diesen Fonds zutreffen, angelegt wird. Der Verwaltungsrat darf mit vorheriger schriftlicher Zustimmung der Zentralbank zu gegebener Zeit zusätzliche Fonds auflegen. Die Gesellschaft wurde am 10. Dezember 1997 gegründet.

PIMCO Global Advisors (Ireland) Limited (die „Verwaltungsgesellschaft“) ist die Verwaltungsgesellschaft der Gesellschaft.

Wie im Verkaufsprospekt der Gesellschaft vorgesehen, wurden Pacific Investment Management Company LLC, PIMCO Europe Ltd und PIMCO Europe GmbH (jeweils eine „Anlageberatungsgesellschaft“) als Anlageberatungsgesellschaften für verschiedene Fonds der Gesellschaft bestellt. PIMCO Asia Limited und PIMCO Asia Pte Ltd (jeweils eine „Anlageberatungsgesellschaft“) haben von der Zentralbank die Genehmigung erhalten, als Anlageberatungsgesellschaft für irische Fonds zu agieren.

Gemäß dem Verkaufsprospekt der Gesellschaft kann jede Anlageberatungsgesellschaft die diskretionäre Anlageverwaltung der Fonds vorbehaltlich aller gesetzlichen und aufsichtsrechtlichen Anforderungen einer oder mehreren Unter-Anlageberatungsgesellschaften übertragen. Wenn für einen bestimmten Fonds eine Anlageberatungsgesellschaft bestellt wurde, hat die Anlageberatungsgesellschaft die jeweils übrigen Anlageberatungsgesellschaften (PIMCO Asia Limited und PIMCO Asia Pte Ltd.) als Unter-Anlageberatungsgesellschaft bezüglich des bzw. der jeweiligen Fonds bestellt. Die Gebühren der einzelnen entsprechend bestellten Unter-Anlageberatungsgesellschaften sind von der Verwaltungsgesellschaft oder von den Anlageberatungsgesellschaften im Namen der Verwaltungsgesellschaft aus der Verwaltungsgebühr zu begleichen.

Der Sitz der Gesellschaft befindet sich in 78 Sir John Rogerson’s Quay, Dublin 2, D02 HD32, Irland.

2. WICHTIGE BILANZIERUNGS- UND BEWERTUNGSMETHODEN

Die bei der Erstellung dieses Abschlusses verwendeten wesentlichen Rechnungslegungs- und Schätzungsmethoden sind mit denen konform, die die Gesellschaft für den geprüften Jahresabschluss der Gesellschaft für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 (der „geprüfte Jahresabschluss“) verwendet hat. Der Abschluss wird für alle Fonds auf der Grundlage der Unternehmensfortführung erstellt.

Erstellungsgrundlage

Bei dem vorliegenden Abschluss handelt es sich um den ungeprüften verkürzten Abschluss für den Sechsmonatszeitraum zum 30. Juni 2023. Er wurde gemäß Financial Reporting Standard („FRS“) 104: „Zwischenberichterstattung“, wie vom Financial Reporting Council („FRC“) veröffentlicht, und den OGAW-Richtlinien veröffentlicht.

Der ungeprüfte verkürzte Abschluss sollte in Verbindung mit dem geprüften Jahresabschluss, der von den Abschlussprüfern einen uneingeschränkten Bestätigungsvermerk erhalten hat und der im Einklang mit den in Irland allgemein anerkannten Rechnungslegungsgrundsätzen (FRS 102), dem Irischen Statut, bestehend aus dem Companies Act (Gesetz über Aktiengesellschaften) von 2014 und den OGAW-Richtlinien erstellt wurde, gelesen werden. Bei den in Irland allgemein für die Erstellung von Rechnungsabschlüssen anerkannten Rechnungslegungsgrundsätzen handelt es sich um diejenigen, die vom FRC herausgegeben werden.

Die in der Aufstellung der ausgewiesenen Gesamtgewinne und -verluste sowie in einer Überleitung der Eigenkapitalveränderungen aufzuführenden Angaben sind nach Meinung des Verwaltungsrats in der Betriebsergebnisrechnung sowie im Ausweis der Nettovermögensänderungen enthalten.

Die Gesellschaft hat von der für offene Investmentfonds, die einen erheblichen Anteil ihres Vermögens in äußerst liquiden und zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen halten, verfügbaren Ausnahmeregelung gemäß Abschnitt 7 von FRS 102 Gebrauch gemacht und legt daher keine Kapitalflussrechnung vor.

Dieser Abschluss wurde nach der Anschaffungskostenregelung unter Zugrundelegung der Neubewertung der ergebniswirksam zum Marktwert bewerteten Finanzvermögen und -verbindlichkeiten aufgestellt.

Die Gesellschaft verwendet den US-Dollar als Präsentationswährung. Die Abschlüsse der einzelnen Fonds werden in der Funktionswährung des Fonds erstellt. Der Finanzstatus der Gesellschaft wird mithilfe von Wechselkursen zum Ende des Berichtszeitraums umgerechnet und die Betriebsergebnisrechnung und der Ausweis der Veränderungen im Nettovermögen der Gesellschaft werden zum durchschnittlichen Wechselkurs (als Annäherung an die tatsächlichen Kurse) des Berichtszeitraums umgerechnet, um diese in den Abschluss der Gesellschaft einzubeziehen.

Alle Beträge wurden, sofern nicht anders angegeben, auf die nächsten Tausend gerundet. Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter tausend liegt. Die Aufstellung des Wertpapierbestands bestimmter Fonds kann übertragbare Wertpapiere halten, die sowohl einen Nennwert von Null als auch einen Marktwert von Null aufweisen, wenn der tatsächliche Nennwert und der Marktwert auf den nächsten Tausender gerundet werden.

Die von der Gesellschaft während des Berichtszeitraums angewandte Swing-Pricing-Methode entspricht der im geprüften Jahresabschluss angewandten Methode.

Zum 30. Juni 2023 wurde Swing Pricing auf den Emerging Markets Bond ESG Fund angewandt. Zum 31. Dezember 2022 wurde Swing Pricing auf den Income Fund II angewandt.

Der NIW je Anteil wird in Erläuterung 16 angegeben und kann eine Swing-Pricing-Anpassung beinhalten. Swing-Price-Anpassungen werden in der Aufstellung der Aktiva und Passiva, der Betriebsergebnisrechnung oder der Aufstellung über die Nettovermögensänderungen ausgewiesen.

3. ANLAGEN ZUM MARKTWERT UND MARKTBEWERTUNGSHIERARCHIE

Die Gesellschaft muss Angaben bezüglich der Marktbewertungshierarchie machen, in die die Bewertungen zum beizulegenden Zeitwert für Vermögenswerte und Verbindlichkeiten eingestuft werden. Die Angaben beruhen auf einer dreistufigen Marktbewertungshierarchie für die in Bewertungsverfahren zur Bemessung des beizulegenden Zeitwerts verwendeten Inputfaktoren.

Der beizulegende Zeitwert ist definiert als der Betrag, zu dem in einem Geschäft zwischen sachverständigen, vertragswilligen und unabhängigen Geschäftspartnern ein Vermögenswert ausgetauscht, eine Verbindlichkeit beglichen oder ein Eigenkapitalinstrument gewährt würde. Es sind getrennte Angaben zur Marktbewertungshierarchie für jede Hauptklasse von Aktiva und Passiva erforderlich, die die Bewertung zum Marktwert in Stufen teilt (Stufen 1, 2 und 3). Diese Inputfaktoren oder Verfahren zur Bewertung von Wertpapieren geben nicht unbedingt das Risiko wieder, dass mit der Anlage in diesen Wertpapieren verbunden ist. Die Stufen 1, 2 und 3 der Marktbewertungshierarchie sind wie folgt definiert:

- Stufe 1 – Quotierte Preise auf aktiven Märkten oder Börsen für identische Aktiva und Passiva.
- Stufe 2 – Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren. Hierzu können insbesondere quotierte Preise für ähnliche Vermögenswerte oder Verbindlichkeiten an Märkten, die aktiv sind, quotierte Preise für identische oder ähnliche Vermögenswerte und Verbindlichkeiten an Märkten, die nicht aktiv sind, andere Inputfaktoren als quotierte Preise, die für die Vermögenswerte und Verbindlichkeiten zu beobachten sind (wie zum Beispiel Zinssätze, Renditekurven, Volatilitäten, Tilgungsgeschwindigkeit, Verlustquoten, Kreditrisiken und Ausfallraten) oder andere bestätigte Inputfaktoren vom Markt zählen.
- Stufe 3 – Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren, die unter diesen Umständen auf bestmöglich verfügbaren Informationen beruhen, wenn beobachtbare Inputfaktoren nicht verfügbar sind, was zur Bestimmung des Marktwerts von Anlagen verwendete Annahmen des Verwaltungsrats oder anderer Personen, die nach seinem Ermessen handeln, einschließen kann.

Bei der Bewertung der erwarteten Wiederherstellung wird geschätzt, dass der beizulegende Zeitwert eines vorhandenen Vermögenswerts abzüglich etwaiger Verbindlichkeiten wiederhergestellt werden kann. Erhebliche Änderungen an den nicht beobachtbaren Inputfaktoren hätten direkte und proportionale Änderungen am Marktwert des Wertpapiers zur Folge. Diese Wertpapiere werden in Stufe 3 der Marktbewertungshierarchie eingeordnet.

Eine Analyse der zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten der einzelnen Fonds zum 30. Juni 2023 und zum 31. Dezember 2022 finden Sie in der Aufstellung des Wertpapierbestands. Die von den Fonds zur Klassifizierung von zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten anhand einer Zeitwerthierarchie verwendete Methode ist mit derjenigen konform, die im geprüften Jahresabschluss angewandt wurde.

4. EFFIZIENTE PORTFOLIOVERWALTUNG

Innerhalb der durch die Anlageziele und Anlagepolitik der Fonds und nach Maßgabe der von der Zentralbank jeweils festgesetzten Grenzen und des laut Prospektbestimmungen erlaubten Umfangs sind die Finanzderivate und Anlagetechniken von allen Fonds für eine effiziente Portfolioverwaltung einzusetzen. Die Fonds können diese Finanzderivate und Anlagetechniken zur Absicherung gegen Zinsänderungen, Devisenkursänderungen in anderen Währungen als der Funktionswährung, gegen Änderungen in Wertpapierkursen oder als Teil ihrer allgemeinen Anlagestrategie einsetzen.

Der durch die Pensionsgeschäfte im Berichtszeitraum zum 30. Juni 2023 entstandene Zinsertrag/(-aufwand) betrug insgesamt 277.072.633 USD/(139.559 USD) (30. Juni 2022: 15.018.247 USD/(1.166.271 USD)).

Der durch die umgekehrten Pensionsgeschäfte im Berichtszeitraum zum 30. Juni 2023 entstandene Zinsertrag/(-aufwand) betrug insgesamt 204.499 USD/(66.620.552 UD) (30. Juni 2022: 8.488.913 USD/(9.218.518 USD)).

Der durch die Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte im Berichtszeitraum zum 30. Juni 2023 entstandene Zinsertrag/(-aufwand) betrug insgesamt 1.074 USD/(2.626.118 USD) (30. Juni 2022: 223.876 USD/(954.715 USD)).

5. DIVIDENDENAUSSCHÜTTUNGSPOLITIK

Wie in der jeweiligen Fondsergänzung angegeben, können Dividendenausschüttungen festgesetzt werden auf:

(i) Nettokapitalerträge, die aus Zinsen und Dividenden abzüglich Aufwendungen bestehen.
(ii) Realisierte Gewinne aus der Veräußerung von Anlagen abzüglich realisierter und nicht realisierter Verluste (einschließlich Gebühren und Aufwendungen). Für den Fall, dass die bei der Veräußerung von Anlagen realisierten Gewinne abzüglich der realisierten und nicht realisierten Verluste negativ sind, können die Fonds dennoch Dividenden aus den Nettokapitalerträgen und/oder Kapital bezahlen.
(iii) Andere Mittel (einschließlich Kapital), die nach dem Gesetz aus dem betreffenden Fonds bzw. der betreffenden Anteilsklasse des betreffenden Fonds ausgeschüttet werden können.

Verwaltungsgebühren und andere Gebühren oder ein Teil davon können dem Kapital belastet werden. Das kann dazu führen, dass das Kapital sinkt und Erträge mit einem verminderten Potenzial für zukünftiges Kapitalwachstum erwirtschaftet werden. Dieser Zyklus kann sich solange fortsetzen, bis das Kapital aufgezehrt ist. Der Grund für die Belastung des Kapitals ist, den an die Anteilinhaber ausschüttbaren Betrag zu maximieren.

Für die Klasse Income II kann der Verwaltungsrat in seinem Ermessen entscheiden, die Gebühren aus dem Kapital zu bezahlen und das Renditedifferenzial zwischen den jeweiligen abgesicherten Anteilsklassen und den grundlegenden Anteilsklassen zu berücksichtigen (was einer Ausschüttung aus dem Kapital entspricht). Das Renditedifferenzial kann positiv oder negativ sein und wird unter Berücksichtigung des Beitrags der Anteilsklassenbesicherung aus den besicherten Klassen berechnet.

Bei den Klassen M Retail, PIMCO Asia High Yield Bond Fund, Asia Strategic Interest Bond Fund, Euro Income Bond Fund, Euro Short-Term Fund, Income Fund, Low Duration Income Fund, Mortgage Opportunities Fund und US Short-Term Fund, außer den Klassen G Institutional, G Retail, E Class ausschüttend und Q, E Class ausschüttend II Q und Investor ausschüttend A (sofern zutreffend), Dividendenausschüttungen monatlich festgesetzt und je nach Wahl des Anteilinhabers monatlich in bar ausgezahlt oder in zusätzliche Anteile reinvestiert.

Für die Anteile der Administrative-Klassen des Diversified Income Fund, BE Retail, BM Retail, BN Retail, M Retail und N Retail Share werden Dividendenausschüttungen monatlich festgesetzt und je nach Wahl des Anteilinhabers monatlich in bar ausgezahlt oder in zusätzliche Anteile reinvestiert.

Für die Anteilsklassen G Institutional, G Retail und Investor ausschüttend A werden Dividendenausschüttungen jährlich festgesetzt und je nach Wahl des Anteilinhabers jährlich in bar ausgezahlt oder in zusätzliche Anteile reinvestiert.

Im Falle aller anderen Fonds mit ausschüttenden Anteilsklassen werden Ausschüttungen vierteljährlich festgesetzt und werden, abhängig von der Entscheidung des Anteilinhabers, in bar ausgezahlt oder nach der Erklärung in zusätzliche Anteile reinvestiert.

Dividendenausschüttungen an Inhaber rückgabeberechtigter Anteile werden in der Betriebsergebnisrechnung als Finanzierungskosten klassifiziert. Die auf die thesaurierenden Anteile entfallenden Erträge oder Kapitalzuwachs werden weder festgesetzt noch ausgeschüttet. Statt dessen wird der NIW je Anteil der thesaurierenden Anteile entsprechend dieser Erträge oder dieses Wertzuwachses erhöht. Dividendenausschüttungen, die nicht in Anteile reinvestiert werden, werden den Anteilinhabern per Banküberweisung ausgezahlt. Dividendenausschüttungen, die nach Ablauf von sechs Jahren ab dem Datum ihrer Erklärung nicht eingefordert werden, verfallen und fließen an den jeweiligen Fonds zurück. Die Anteilinhaber können sich entscheiden, die Dividendenausschüttungen in zusätzliche Anteile zu reinvestieren oder sich die Dividendenausschüttungen bar auszahlen zu lassen, indem sie das entsprechende Kästchen im Antragsformular auswählen.

Für die nachfolgenden Fonds wurde ein Teil der Dividendenausschüttungen gemäß der Betriebsergebnisrechnung aus dem Kapital gezahlt (Angaben in Tausend):

Fonds	Zwischenabschluss 30. Juni 2023	Zwischenabschluss 30. Juni 2022
PIMCO Asia High Yield Bond Fund	$ 0	$ 50
PIMCO Capital Securities Fund	311	32
PIMCO Climate Bond Fund	94	1
Diversified Income Fund	2.113	6.698
Diversified Income Duration Hedged Fund	1.240	1.317
Dynamic Bond Fund	811	331
Dynamic Multi-Asset Fund	€ 725	€ 2.994
PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund	$ 2	$ 0
Global Bond Fund	549	944
Global Bond ESG Fund	209	0
PIMCO Global Core Asset Allocation Fund	729	1.533
Global High Yield Bond Fund	501	1.504
Global Investment Grade Credit Fund	1.892	0
Global Investment Grade Credit ESG Fund	461	0
Global Low Duration Real Return Fund	1.172	21
Global Real Return Fund	5.083	883
Income Fund	5.888	191
Low Average Duration Fund	15	115
Low Duration Global Investment Grade Credit Fund	13	0
Low Duration Income Fund	3	0
Low Duration Opportunities Fund	1.716	772
Strategic Income Fund	1	0
Total Return Bond Fund	0	123
UK Corporate Bond Fund	£ 363	£ 319
UK Long Term Corporate Bond Fund	9	67
US High Yield Bond Fund	$ 1	$ 0

6. SOFT COMMISSIONS

Die Gesellschaft bzw. ihre Anlageberatungsgesellschaft kann Transaktionen im Namen der Fonds über oder mit Unterstützung von Ausführungsmaklern durchführen, die zusätzlich zur routinemäßigen Order-Ausführung gelegentlich Güter, Dienstleistungen oder andere Vorteile wie etwa Research- und Beratungsdienste für die Gesellschaft oder ihre Beauftragten bereitstellen oder beschaffen können. Die Gesellschaft bzw. ihre Anlageberatungsgesellschaft kann diesen Brokern Full-Service-Provisionssätze zahlen, die teilweise für die Bereitstellung zulässiger Güter oder Dienstleistungen verwendet werden können. Diejenigen Anlageberatungsgesellschaften, bei denen es sich um Anlagegesellschaften gemäß der Verordnung über Märkte für Finanzinstrumente (Markets in Financial Instruments Directive, „MiFID“) handelt oder die gleichwertigen aufsichtsrechtlichen Bestimmungen unterliegen, müssen Research-Leistungen Dritter, die sie im Zusammenhang mit der Verwaltung des Vermögens der einzelnen Fonds kaufen, direkt aus ihren eigenen Mitteln bezahlen.

7. GETRENNTE HAFTUNG

Die Gesellschaft ist eine offene Investmentgesellschaft des Umbrella-Typs mit variablem Kapital und Haftungstrennung zwischen ihren Teilfonds. Dementsprechend sind etwaige Verbindlichkeiten, die im Namen eines Fonds der Gesellschaft entstanden oder diesem zuzuordnen sind, ausschließlich aus den Vermögenswerten des betreffenden Fonds zu begleichen, und weder die Gesellschaft noch ein Verwaltungsratsmitglied, Revisor, Insolvenzverwalter, kommissarischer Insolvenzverwalter oder sonstige Personen dürfen

Personen dürfen die Vermögenswerte dieses Fonds zum Ausgleich von Verbindlichkeiten im Namen eines anderen Fonds der Gesellschaft verwenden oder sind verpflichtet, sie hierzu zu verwenden, unabhängig davon, wann diese Verbindlichkeit entstanden ist.

8. ÄNDERUNGEN AM PROSPEKT, AN DER GRÜNDUNGSUKRUNDE UND DER SATZUNG

Am 03. Januar 2023 wurden die Ergänzungen für den Low Duration Income Fund und den Income Fund II aktualisiert, um den Verzicht auf die Verwaltungsgebühr zu ändern.

Am selben Tag wurden die Ergänzungen für den Euro Bond Fund, Euro Credit Fund, Euro Income Bond Fund, Euro Long Average Duration Fund, PIMCO Capital Securities Fund, PIMCO Global Core Asset Allocation Fund, UK Corporate Bond Fund, UK Long Term Corporate Bond Fund und Dynamic Multi Asset Fund aktualisiert, um die Handelstage zu ändern.

Am 18. Januar 2023 wurden die Ergänzungen für die Fonds Euro Short-Term Fund und PIMCO European Short-Term Opportunities Fund aktualisiert, um den Verzicht auf die Verwaltungsgebühr zu ändern.

Am 19. April 2023 wurden die Ergänzungen für den PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund, Inflation Multi-Asset Fund und PIMCO Global Core Asset Allocation Fund aktualisiert, um die Anlagepolitik dahingehend zu ändern, dass die Fonds bis zu 20 % ihres Nettovermögens in strukturierte Schuldverschreibungen anlegen können, wie in den Ergänzungen näher beschrieben. Die strukturierten Schuldverschreibungen ändern die Anlagepolitik nicht wesentlich und werden verwendet, um ein Engagement in Sektoren zu erzielen, die bereits in der Anlagepolitik berücksichtigt wurden.

Am 16. Mai 2023 wurde der Nachtrag für den PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund aktualisiert, um zu präzisieren, dass nicht alle Energiesektoren Teil des Rohstoffengagement-Universums des Fonds sind. Diese Präzisierung wurde vom Anlageberater als Verbesserung des gesamten Anlageprozesses des Fonds empfohlen und stellt in keiner Weise eine wesentliche Änderung der Anlagepolitik des Fonds dar.

Am 16. Mai wurde die Ergänzung für den StocksPLUS™ Fund aktualisiert, um die Anlagerichtlinie zu entfernen, die besagt, dass der Fonds mindestens 50 % in festverzinslichen Wertpapieren mit derselben Abrechnung halten muss. Diese spezielle (historische) selbstauferlegte Anlagerichtlinie muss aus aufsichtsrechtlicher Sicht nicht in die Ergänzung aufgenommen werden, und unabhängig von dieser Offenlegung wird der Teilfonds in Übereinstimmung mit seinen OGAW-Liquiditätsverpflichtungen verwaltet. Durch die Änderung wird die Ergänzung mit anderen ähnlichen Strategien in Einklang gebracht und stellt in keiner Weise eine wesentliche Änderung der Anlagepolitik dar.

Am 02. Juni 2023 wurden die Ergänzungen für den PIMCO Climate Bond Fund aktualisiert, um den Verzicht auf Verwaltungsgebühren zu ändern.

Am 30. Juni 2023 wurde die Ergänzung für den Euro Credit Fund aktualisiert, um den Verzicht auf die Verwaltungsgebühr in Höhe von 25 BPS für die Anteilsklasse H Institutional um ein Jahr auf den 30. Juni 2024 zu verlängern.

An der Gründungsurkunde und der Satzung der Gesellschaft wurden während des Berichtszeitraums keine Änderungen vorgenommen.

9. GEBÜHREN UND KOSTEN

(a) An die Verwaltungsgesellschaft zu zahlende Gebühren

Mit Ausnahme der BN Retail Shares, BM Retail Shares und BE Retail Shares, wie in der entsprechenden Ergänzung für den Fonds angegeben, darf die einheitliche Gebühr 2,50 % p. a. des NIW jedes Fonds nicht übersteigen.

(b) Verwaltungsgebühr

Die Verwaltungsgesellschaft erbringt oder liefert für jeden Fonds, wie im Prospekt beschrieben, Anlageberatungs-, Administrations-, Verwahr- und sonstige Dienste, für die jeder Fonds eine einzige Verwaltungsgebühr an die Verwaltungsgesellschaft zahlt. Die Verwaltungsgebühr (wie im Verkaufsprospekt definiert) für jeden Fonds läuft an jedem Handelstag (wie in der Ergänzung für den jeweiligen Fonds definiert) auf und ist monatlich rückwirkend zahlbar. Die Verwaltungsgesellschaft kann die Verwaltungsgebühr vollständig oder teilweise an die Anlageberatungsgesellschaften entrichten, um die von diesen erbrachten Anlageberatungs- und anderen Dienste zu bezahlen und damit die Anlageberatungsgesellschaften die Kosten für die Administrations-, Verwahr- und anderen Dienste begleichen können, die die Verwaltungsgesellschaft für die Fonds erbracht hat.
Die Verwaltungsgebühr für die einzelnen Klassen der einzelnen Fonds (angegeben in Prozent pro Jahr ihres NIW) lautet wie folgt:

	Klassen Inst'l, G Inst'l, Inv, Admin (%)	H Inst'l (%)	BE Retail BM Retail BN Retail E Class, G Retail, M Retail, N Retail, T Class (%)	R Class (%)	W Class (%)
PIMCO Asia High Yield Bond Fund	0,65	0,82	1,55	k. A.	k. A.
Asia Strategic Interest Bond Fund	0,65	k. A.	1,50	k. A.	k. A.
PIMCO Capital Securities Fund	0,79	k. A.	1,69	0,93	k. A.
PIMCO Climate Bond Fund(1)	0,52	k. A.	1,42	k. A.	k. A.
Commodity Real Return Fund	0,74	0,91	1,64	k. A.	k. A.
PIMCO Credit Opportunities Bond Fund	0,90	k. A.	1,80	k. A.	k. A.
Diversified Income Fund	0,69	0,86	1,59	k. A.	0,55
Diversified Income Duration Hedged Fund	0,69	k. A.	1,59	k. A.	k. A.
Diversified Income ESG Fund	0,72	k. A.	1,62	k. A.	k. A.
Dynamic Bond Fund	0,90	1,07	1,80	0,99	k. A.
Dynamic Multi-Asset Fund	0,85	1,02	1,85	k. A.	k. A.
Emerging Local Bond Fund	0,89	1,06	1,89	k. A.	k. A.
Emerging Local Bond ESG Fund	0,92	k. A.	1,92	k. A.	k. A.
Emerging Markets Bond Fund	0,79	0,96	1,69	k. A.	k. A.
Emerging Markets Bond ESG Fund	0,89	k. A.	1,74	k. A.	k. A.
Emerging Markets Corporate Bond Fund	0,95	k. A.	1,85	k. A.	k. A.
PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund(2)	0,95	k. A.	1,85	k. A.	k. A.
Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund	0,85	k. A.	1,75	k. A.	k. A.
PIMCO ESG Income Fund	0,59	k. A.	1,49	0,82	k. A.
Euro Bond Fund	0,46	k. A.	1,36	k. A.	k. A.
Euro Credit Fund(3)	0,46	0,38	1,36	k. A.	k. A.
Euro Income Bond Fund	0,49	k. A.	1,39	k. A.	k. A.
Euro Long Average Duration Fund	0,46	k. A.	k. A.	k. A.	k. A.
Euro Short-Term Fund(4)	0,29	k. A.	1,04	k. A.	k. A.
PIMCO European High Yield Bond Fund	0,55	k. A.	1,45	k. A.	k. A.
PIMCO European Short-Term Opportunities Fund(5)	0,32	0,49	0,82	k. A.	k. A.
Global Advantage Fund	0,70	k. A.	1,70	k. A.	k. A.
Global Bond Fund	0,49	0,66	1,39	0,76	0,39
Global Bond ESG Fund	0,52	k. A.	1,42	k. A.	k. A.
Global Bond Ex-US Fund	0,49	0,66	1,39	k. A.	k. A.
PIMCO Global Core Asset Allocation Fund	0,95	1,12	2,15	k. A.	k. A.
Global High Yield Bond Fund	0,55	0,72	1,45	0,80	k. A.
Global Investment Grade Credit Fund	0,49	0,66	1,39	0,76	0,39
Global Investment Grade Credit ESG Fund	0,52	k. A.	1,42	k. A.	k. A.
Global Low Duration Real Return Fund	0,49	k. A.	1,39	k. A.	k. A.
Global Real Return Fund	0,49	0,66	1,39	0,76	k. A.
Income Fund	0,55	0,72	1,45	0,80	k. A.
Income Fund II	0,59	k. A.	1,49	k. A.	k. A.
Inflation Multi-Asset Fund	0,79	0,96	1,69	k. A.	k. A.

	Klassen Inst'l, G Inst'l, Inv, Admin (%)	H Inst'l (%)	BE Retail BM Retail BN Retail E Class, G Retail, M Retail, N Retail, T Class (%)	R Class (%)	W Class (%)
Low Average Duration Fund	0,46	0,63	1,36	0,75	k. A.
Low Duration Global Investment Grade Credit Fund	0,49	k. A.	1,39	k. A.	k. A.
Low Duration Income Fund(6)	0,55	0,72	1,45	k. A.	k. A.
Low Duration Opportunities Fund	0,49	k. A.	1,20	k. A.	k. A.
Low Duration Opportunities ESG Fund	0,52	k. A.	k. A.	k. A.	k. A.
PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund	0,99	k. A.	1,89	k. A.	k. A.
Mortgage Opportunities Fund	0,69	0,86	1,59	k. A.	k. A.
StocksPLUS™ Fund	0,55	0,72	1,45	k. A.	k. A.
PIMCO StocksPLUS™ AR Fund	0,69	k. A.	k. A.	k. A.	k. A.
Strategic Income Fund	0,79	k. A.	1,69	k. A.	k. A.
Total Return Bond Fund	0,50	0,67	1,40	0,77	k. A.
PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund	1,40	1,57	2,50	k. A.	k. A.
UK Corporate Bond Fund	0,46	k. A.	k. A.	k. A.	k. A.
UK Long Term Corporate Bond Fund	0,46	k. A.	k. A.	k. A.	k. A.
US High Yield Bond Fund	0,55	0,72	1,45	0,80	k. A.
US Investment Grade Corporate Bond Fund	0,49	0,66	1,39	k. A.	k. A.
US Short-Term Fund(7)	0,45	0,62	0,85	k. A.	k. A.

(1) Diese Zahl berücksichtigt einen Verzicht auf die Gebühr der Verwaltungsstelle mit einem Satz von 0,05 % in Bezug auf die Investor Class vom 31. Mai 2021 bis zum 31. Mai 2023. Der Gebührenverzicht endete am 1. Juni 2023.

(2) Bei allen Klassen wird bei dieser Zahl ein Verzicht auf die Gebühr der Verwaltungsstelle in Höhe von 0,15 % p. a. berücksichtigt. (Vor dem 1. Juni 2023 betrug der Verzicht auf die Gebühr 0,30 % p. a.) Der Verzicht auf die Gebühr läuft zum 1. Juni 2024 ab und kann bis zu dem Zeitpunkt verlängert werden, zu dem die Verwaltungsstelle durch vorherige schriftliche Mitteilung an die Anteilinhaber des Fonds entscheidet, diese Gebühr aufzuheben oder künftig nicht mehr anzuwenden.

(3) Bei der Klasse H Institutional wird ein Verzicht auf die Gebühr der Verwaltungsgesellschaft in Höhe von 0,25 % p. a. berücksichtigt. Der Verzicht auf die Gebühr wird bis zum 30. Juni 2024 verlängert und läuft zum 1. Juli 2024 ab.

(4) In den Gebühren der Klassen Institutional Class und E Class wird ein Verzicht auf die Gebühr der Verwaltungsstelle in Höhe von 0,11 % p. a. bis zum 31. Mai 2021 berücksichtigt. Der Gebührenverzicht endet am 19. Januar 2024.

(5) Bei den Klassen Institutional und H Institutional Class wird bei dieser Zahl ein Verzicht auf die Gebühr der Verwaltungsstelle in Höhe von 0,14 % p. a. berücksichtigt. Bei der Klasse E wird ein Verzicht auf die Gebühr der Verwaltungsstelle in Höhe von 0,54 % p. a. berücksichtigt. Der Verzicht auf die Gebühr läuft am 18. Januar 2024 ab.

(6) Bei allen Klassen wird bei der Zahl der Verzicht auf die Gebühr der Verwaltungsstelle in Höhe von 0,05 % p. a. berücksichtigt. Der Verzicht wird bis zu dem Zeitpunkt verlängert, zu dem die Verwaltungsstelle durch vorherige schriftliche Mitteilung an die Anteilinhaber des Fonds entscheidet, diese Gebühr künftig nicht mehr erheben oder zu reduzieren.

(7) In den Gebühren für die Anteilsklassen E Class, G Retail und M Retail wird ein Gebührenverzicht der Verwaltungsgesellschaft in Höhe von 0,30 % p.a. berücksichtigt. Der Gebührenverzicht wird bis zu dem Zeitpunkt verlängert, zu dem die Verwaltungsgesellschaft durch vorherige schriftliche Mitteilung an die Anteilinhaber des Fonds entscheidet, diese Gebühr künftig nicht mehr zu erheben oder zu reduzieren.

Die Verwaltungsgebühren für alle Fonds (mit Ausnahme der Fonds Inflation Multi-Asset Fund, PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund und Strategic Income Fund) blieben während der Berichtszeiträume zum 30. Juni 2023 und 30. Juni 2022 unverändert, mit Ausnahme der vorstehend aufgeführten Änderungen bezüglich des Verzichts auf die Gebühr.

Die Verwaltungsgebühr für die Anteilsklassen H Institutional, BE Retail, BM Retail, BN Retail, E Class, G Retail, M Retail, N Retail und T Class fällt allgemein höher aus als die Verwaltungsgebühr für die anderen Anteilsklassen. Aus dieser höheren Gebühr kann die Verwaltungsgesellschaft die Kosten für Vertriebs-, Mittler- oder andere Dienste begleichen, die Vertriebsstellen, Wertpapierhändler, Banken, Finanzintermediäre oder andere Intermediäre den Anteilinhabern dieser Anteilsklassen der Fonds direkt oder indirekt erbringen. Da es sich bei der Verwaltungsgebühr um einen festen Betrag handelt, wird das Risiko von Preiserhöhungen bei den Kosten für durch die Verwaltungsgebühr abgedeckte Dienste von der Verwaltungsgesellschaft und nicht von den Anteilinhabern getragen. Die Verwaltungsgesellschaft trägt darüber hinaus das Risiko, dass das Ausgabenniveau für diese Dienste aufgrund eines sinkenden Nettovermögens die Höhe der Verwaltungsgebühr übersteigt. Auf der anderen Seite kämen alle Preissenkungen für von der Verwaltungsgebühr abgedeckte Dienste der Verwaltungsgesellschaft und nicht den Anteilinhabern zugute. Dies betrifft u.a. geringere Kosten (in Prozent des Nettovermögens) aufgrund eines steigenden Nettovermögens.

Aufgrund der Art der Emission von Z Class wird in der Betriebsergebnisrechnung keine Verwaltungsgebühr ausgewiesen (die Class Z werden primär für andere Fonds der Gesellschaft oder für Direktanlagen durch institutionelle Anleger angeboten, die mit den Anlageberatungsgesellschaften oder einem verbundenen Unternehmen von PIMCO eine Anlageverwaltungsvereinbarung oder sonstige Vereinbarung abgeschlossen haben). Um doppelte Gebühren zu vermeiden, wird die Verwaltungsgebühr für die Z Class auf 0,00 % pro Jahr festgesetzt.

(c) Anlageberatungsdienste

Im Namen der Gesellschaft erbringt bzw. veranlasst die Verwaltungsgesellschaft Anlageberatungsdienstleistungen. Zu diesen Dienstleistungen gehören die Anlage und Wiederanlage der Vermögenswerte jedes Fonds. Die Gebühren der Anlageberatungsgesellschaften (zuzüglich gegebenenfalls hierauf anfallender MwSt.) werden von der Verwaltungsgesellschaft aus der Verwaltungsgebühr beglichen.

(d) Administrations-, Verwahr- sowie sonstige Dienste

Im Namen der Gesellschaft erbringt bzw. veranlasst die Verwaltungsgesellschaft Administrations-, Verwahr- und sonstige Dienste. Diese Dienste beinhalten Administrations-, Übertragungsstellen-, Fondsbuchhaltungs-, Verwahr- und Unterverwahrdienste für die jeweiligen Fonds. Die Gebühren und Aufwendungen des Administrators und der Verwahrstelle (zuzüglich gegebenenfalls hierauf anfallender MwSt.) werden von der Verwaltungsgesellschaft aus der Verwaltungsgebühr bzw. von den Anlageberatungsgesellschaften gezahlt.

Im Namen der Gesellschaft erbringt bzw. veranlasst die Verwaltungsgesellschaft bestimmte sonstige Dienste. Diese können enthalten: Dienste von Notierungsmaklern, Zahlstellen und anderen Vertretern vor Ort sowie Buchhaltungs-, Prüf-, Rechts- sowie sonstige Dienste qualifizierter Berater, Gesellschaftssekretärsdienste, Druck-, Veröffentlichungs- und Übersetzungsdienste sowie die Erbringung und Koordination bestimmter Aufsichts-, Administrations- und Anteilinhaberdienste, die für den Betrieb der Fonds erforderlich sind. Gebühren und ordentliche Aufwendungen für diese Dienste (zuzüglich gegebenenfalls hierauf anfallender MwSt.) werden von der Verwaltungsgesellschaft oder von den Anlageberatungsgesellschaften für die Verwaltungsgesellschaft aus der Verwaltungsgebühr gezahlt.

Die Fonds übernehmen sonstige Aufwendungen im Zusammenhang mit ihrem Betrieb, die nicht von der Verwaltungsgebühr abgedeckt werden und die variieren und die Gesamthöhe der Aufwendungen der Fonds beeinflussen können. Hierzu zählen unter anderem Steuern und staatliche Abgaben, Maklergebühren, Provisionen und sonstige Transaktionskosten (einschließlich u. a. Gebühren und Aufwendungen im Zusammenhang mit Due-Diligence-Prüfungen von Anlagen und potenziellen Anlagen und/oder im Zusammenhang mit Verhandlungen über solche Transaktionen), Fremdfinanzierungskosten einschließlich Zinsaufwand, Gründungskosten, außerordentliche Aufwendungen (wie Prozesskosten und Schadenersatzleistungen) sowie die Gebühren und Aufwendungen der unabhängigen Verwaltungsratsmitglieder der Gesellschaft sowie ihrer Berater.

Die Gesellschaft bezahlte den unabhängigen Verwaltungsratsmitgliedern während des Berichtszeitraums zum 30. Juni 2023 Honorare in Höhe von 90.000 EUR (30. Juni 2022: 90.000 EUR). Darüber hinaus werden jedem unabhängigen Verwaltungsratsmitglied alle angemessenen Auslagen erstattet. Nicht unabhängige Verwaltungsratsmitglieder haben keinen Anspruch auf eine separate Vergütung für ihre Verwaltungsratsmandat der Gesellschaft. Die Verwaltungsratshonorare sind in den „Sonstigen Aufwendungen" der Betriebsergebnisrechnung enthalten.

Servicegebühr Die Servicegebühr, die ausschließlich für die Investor Classes anfällt, ist an die Verwaltungsgesellschaft zu zahlen und darf verwendet werden, um Wertpapierhändler, Finanzintermediäre oder sonstige Intermediäre zu vergüten, die Dienste im Zusammenhang mit dem Vertrieb und der Vermarktung von Anteilen erbringen und/oder für die Erbringung bestimmter Anteilinhaberdienstleistungen oder für die Verwaltung von Plänen oder Programmen, die Fondsanteile als Finanzierungsmittel verwenden, und um sonstige verbundene Aufwendungen (wie in der Ergänzung für den jeweiligen Fonds definiert) zu erstatten. Die Verwaltungsgesellschaft erbringt diese Dienste direkt oder indirekt über Wertpapierhändler, Finanzintermediäre oder sonstige Intermediäre für alle Anteilinhaber der Investor Classes. Alle Anteilinhaber der Investor Classes erhalten identische Dienstleistungen für die erhobenen Gebühren. Diese Dienste können beinhalten: die Beantwortung von

Anteilinhaberanfragen zu den Fonds und ihrer Wertentwicklung, die Unterstützung von Anteilinhabern beim Erwerb, der Rücknahme und dem Tausch von Anteilen, die Führung von individueller Kontoinformationen und die Bereitstellung von Kontoauszügen an die Anteilinhaber sowie die Führung sonstiger Unterlagen, die für die Anlage der Anteilinhaber im Fonds relevant sind.

Pläne oder Programme, die Fondsanteile als Finanzierungsmittel verwenden, können fondsgebundene Versicherungsprodukte sowie Pensions-, Altersversorgungs- oder Sparpläne von Arbeitgebern beinhalten. Alle Anteilinhaber der Investor Classes erhalten Dienstleistungen entsprechend der Vereinbarungen mit den Finanzintermediären, mit denen die Anteilinhaber ein Dienstleistungsverhältnis unterhalten. Die Servicegebühr errechnet sich jährlich aus 0,35 % des NIW des jeweiligen Fonds, der auf die Investor Classes entfällt. Die Servicegebühren blieben während der Berichtszeiträume zum 30. Juni 2023 und 30. Juni 2022 unverändert. Die Servicegebühr wird aus dem NIW gezahlt, der auf den NIW der Investor Classes dieser Fonds entfällt. Die Servicegebühr für die einzelnen Fonds läuft an jedem Handelstag auf und ist monatlich im Nachhinein zahlbar. Die Verwaltungsgesellschaft darf zu ihrer eigenen Verwendung etwaige Servicegebühren ganz oder teilweise einbehalten, die nicht an Wertpapierhändler, Banken, Finanzintermediäre oder sonstige Intermediäre zu zahlen sind.

Bestandspflegegebühr: Die Bestandspflegegebühr für Administrative-Klassen ist zahlbar an die Vertriebsstelle für persönliche Dienste, die sie den Anteilinhabern der Fonds erbringt, und für die Führung der Anteilinhaberkonten, einschließlich der Vergütung und der Aufwendungen (einschließlich Telefon- und Gemeinkosten) von Finanzberatern und sonstigen Mitarbeitern beteiligter oder involvierter Händler, bestimmter Banken oder anderer Finanzintermediäre, die bei der Abwicklung von Kauf- oder Rücknahmeanträgen oder der Abwicklung von Dividendenzahlungen unterstützend tätig sind, den Anteilinhabern regelmäßig Informationen über ihre Beteiligung an den Fondsanteilen liefern, Informationen von der Gesellschaft an die Anteilinhaber weitergeben, laufende Beratungsleistungen in Bezug auf die Eignung bestimmter vom Fonds angebotener Anlagemöglichkeiten vor dem Hintergrund der Anteilinhaberanforderungen erbringen, Anfragen der Anteilinhaber zu diesen Diensten beantworten oder Mitarbeiter für die Erbringung derartiger Dienste schulen.

Die Vertriebsstelle erbringt diese Dienste direkt oder indirekt über Wertpapierhändler, Banken, Finanzintermediäre oder sonstige Intermediäre für alle Inhaber von Administrative-Klassen. Die Bestandspflegegebühr wird auf der Grundlage von jährlich 0,50 % des NIW jedes Fonds berechnet, mit Ausnahme des StocksPLUS™ Fund, dessen Berechnung auf der Grundlage von jährlich 0,75 % erfolgt und der den Administrative-Klassen zuzuordnen ist. Die Bestandspflegegebühr für die einzelnen Fonds läuft an jedem Handelstag auf und ist monatlich rückwirkend zahlbar. Die Vertriebsstelle darf zu ihrer eigenen Verwendung etwaige Bestandspflegegebühren ganz oder teilweise einbehalten, die nicht an Wertpapierhändler, Banken, Finanzintermediäre oder sonstige Intermediäre zu zahlen sind.

Die Bestandspflegegebühren blieben während der Berichtszeiträume zum 30. Juni 2023 und 30. Juni 2022 unverändert.

(e) Vertriebsgebühr

Die Vertriebsgebühr, die für die Klassen T Class Shares, BN Retail Shares, BM Retail Shares und BE Retail Share anwendbar ist, wird an die Vertriebsstelle für Dienste bezahlt, die diese Anteilinhabern des Fonds erbracht hat.

Die Vertriebsstelle erbringt diese Dienste direkt oder indirekt über Wertpapierhändler, Banken, Finanzintermediäre oder sonstige Intermediäre für alle Inhaber von Anteilsklassen der T Class. Die Vertriebsgebühr errechnet sich aus 0,40 % p. a. des NIW des jeweiligen Fonds, der auf die Klassen der T Class entfällt, außer in Bezug auf den PIMCO Asia High Yield Bond Fund, PIMCO Credit Opportunities Bond Fund, Dynamic Bond Fund, Euro Bond Fund, Global Bond Fund, Global Bond ESG Fund, Global Bond Ex-US Fund, Global Low Duration Real Return Fund, Global Real Return Fund, Low Duration Opportunities Fund, PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund und Total Return Bond Fund. Für diese Fonds wird eine Vertriebsgebühr in Höhe von 0,30 % p. a. auf den NIW der Anteile der T Class dieser Fonds bezahlt.

Nur in Bezug auf die Anteilsklassen BE Retail, BM Retail und BN Retail kann die Vertriebsgebühr, sofern in der entsprechenden Ergänzung angegeben, bis zu 1 % des NIW betragen. Daher kann die Vertriebsgebühr 2,50 % des NIW übersteigen.

Die Vertriebsgebühr für die einzelnen Fonds läuft an jedem Handelstag auf und ist monatlich im Nachhinein zahlbar. Die Vertriebsstelle darf zu ihrer eigenen Verwendung etwaige Vertriebsgebühren ganz oder teilweise einbehalten, die nicht an Wertpapierhändler, Banken, Finanzintermediäre oder sonstige Intermediäre zu zahlen sind.

(f) Ausgabenbegrenzung (einschließlich Verzicht auf und Nachzahlung von Verwaltungsgebühren)

Gemäß der geltenden Fassung des Verwaltungsvertrags zwischen der Gesellschaft und der Verwaltungsgesellschaft vom 28. Januar 1998 ist die Verwaltungsgesellschaft mit der Gesellschaft übereingekommen, die gesamten jährlichen Betriebskosten eines Fonds für alle Klassen des Fonds zu verwalten, wobei sie auf ihre Verwaltungsgebühr ganz oder teilweise verzichtet bzw. diese ganz oder teilweise reduziert oder erstattet, falls (und für den Zeitraum, in dem) diese Betriebskosten aufgrund gezahlter Gründungskosten sowie anteiliger Verwaltungsratshonorare die Summe aus der Verwaltungsgebühr der Klasse dieses Fonds (vor Anrechnung eines etwa anwendbaren Verzichts auf die Verwaltungsgebühr) aus etwa anfallenden Dienste- und Bestandspflegegebühren sowie aus sonstigen von dieser Fondsklasse zu tragenden Kosten, die die oben beschriebene Verwaltungsgebühr nicht abdeckt (ausgenommen Gründungskosten und anteilige Verwaltungsratshonorare) zzgl. 0,0049 % p. a. (täglich auf Basis des Fonds-NIW berechnet) überschreiten.

In jedem Monat, in dem der Verwaltungsvertrag gilt, darf die Verwaltungsgesellschaft von einem Fonds einen beliebigen Anteil der Verwaltungsgebühr wiedererlangen, auf die sie verzichtet, die sie reduziert oder erstattet hat, und dies gemäß dem Verwaltungsvertrag (der „Erstattungsbetrag“) während der vorangegangenen 36 Monate, vorausgesetzt dieser an die Verwaltungsgesellschaft gezahlte Betrag erfüllt folgende Bedingungen: 1) er darf 0,0049 % p. a. vom durchschnittlichen (täglich berechneten) Nettovermögen der Klasse des betreffenden Fonds nicht überschreiten; 2) er liegt nicht über dem Gesamterstattungsbetrag; 3) enthält keine der Verwaltungsgesellschaft zuvor erstatteten Beträge; bzw. 4) führt nicht dazu, dass eine Klasse eines Fonds einen negativen Ertrag behält.

Die in der Betriebsergebnisrechnung angegebene Verwaltungsgebühr wird vor Berücksichtigung des jeweils gegebenenfalls gewährten Verzichts auf Verwaltungsgebühren angegeben. Die Verzichte auf Verwaltungsgebühren werden in der Betriebsergebnisrechnung unter Erstattungen der Anlageberatungsgesellschaft ausgewiesen. Die Verwaltungsgebühr wird der Verwaltungsgesellschaft nach Berücksichtigung des Verzichts gezahlt.

10. TRANSAKTIONEN ZWISCHEN VERBUNDENEN PARTEIEN

Bei der Verwaltungsgesellschaft, den Anlageberatungsgesellschaften, den Vertriebsstellen und den Verwaltungsratsmitgliedern handelt es sich um verbundene Parteien der Gesellschaft. An diese Parteien gegebenenfalls zahlbare Gebühren werden in Erläuterung 9 offengelegt.

Zum 30. Juni 2023 hielt die Verwaltungsgesellschaft 1.162.694 (31. Dezember 2022: 1.786.291) Anteile des US Short-Term Fund.

Jeder Fonds kann in anderen Fonds der Gesellschaft und/oder anderen Organismen für gemeinsame Anlagen anlegen, die von der Verwaltungsstelle oder von mit der Verwaltungsstelle verbundenen Entitäten verwaltet werden („verbundener Fonds“).

Die folgenden Fonds hielten im Berichtszeitraum zum 30. Juni 2023 Überkreuzinvestitionen innerhalb des Umbrella-Fonds. Diese Anlagen wurden zum Zweck der Darstellung der Summe der Fonds der Gesellschaft eliminiert.

	30. Jun. 2023
Fonds	Überkreuzinvestitionen innerhalb des Umbrella-Fonds
Diversified Income Fund	PIMCO Asia High Yield Bond Fund
Diversified Income Fund	Asia Strategic Interest Bond Fund
Diversified Income Fund	PIMCO European High Yield Bond Fund
Diversified Income Fund	US Short-Term Fund
Diversified Income Duration Hedged Fund	PIMCO Asia High Yield Bond Fund
Diversified Income Duration Hedged Fund	Asia Strategic Interest Bond Fund
Diversified Income Duration Hedged Fund	PIMCO European High Yield Bond Fund
Diversified Income Duration Hedged Fund	US Short-Term Fund
Dynamic Bond Fund	PIMCO Asia High Yield Bond Fund
Dynamic Bond Fund	Asia Strategic Interest Bond Fund
Dynamic Bond Fund	US Short-Term Fund
Dynamic Multi-Asset Fund	PIMCO Capital Securities Fund
Dynamic Multi-Asset Fund	Income Fund
Dynamic Multi-Asset Fund	PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund
Emerging Local Bond Fund	Asia Strategic Interest Bond Fund
Emerging Local Bond Fund	Emerging Local Bond ESG Fund

Fonds	30. Jun. 2023 Überkreuzinvestitionen innerhalb des Umbrella-Fonds
Emerging Local Bond Fund	PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund
Emerging Markets Bond Fund	PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund
Euro Income Bond Fund	PIMCO European High Yield Bond Fund
Global Bond Fund	PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund
Global Bond Fund	PIMCO European High Yield Bond Fund
Global Bond Fund	Global Bond Ex-US Fund
Global Bond Fund	UK Corporate Bond Fund
Global Bond Fund	US Short-Term Fund
Global Bond ESG Fund	Global Investment Grade Credit ESG Fund
Global High Yield Bond Fund	PIMCO Asia High Yield Bond Fund
Global High Yield Bond Fund	PIMCO European High Yield Bond Fund
Global Investment Grade Credit Fund	PIMCO Asia High Yield Bond Fund
Global Investment Grade Credit Fund	Asia Strategic Interest Bond Fund
Global Investment Grade Credit Fund	PIMCO European High Yield Bond Fund
Low Average Duration Fund	US Short-Term Fund
Low Duration Opportunities Fund	PIMCO Asia High Yield Bond Fund
Low Duration Opportunities Fund	Asia Strategic Interest Bond Fund
Total Return Bond Fund	US Short-Term Fund
US High Yield Bond Fund	PIMCO Asia High Yield Bond Fund

Die folgenden Fonds hielten zum 31. Dezember 2022 Umbrellafonds-interne Überkreuzinvestitionen. Diese Anlagen wurden zum Zweck der Darstellung der Summe der Gesellschaft im vergleichenden Finanzstatus der Fonds eliminiert.

Fonds	31. Dez. 2022 Überkreuzinvestitionen innerhalb des Umbrella-Fonds
Diversified Income Fund	PIMCO Asia High Yield Bond Fund
Diversified Income Fund	Asia Strategic Interest Bond Fund
Diversified Income Fund	PIMCO European High Yield Bond Fund
Diversified Income Fund	US Short-Term Fund
Diversified Income Duration Hedged Fund	PIMCO Asia High Yield Bond Fund
Diversified Income Duration Hedged Fund	Asia Strategic Interest Bond Fund
Diversified Income Duration Hedged Fund	PIMCO European High Yield Bond Fund
Diversified Income Duration Hedged Fund	US Short-Term Fund
Dynamic Bond Fund	PIMCO Asia High Yield Bond Fund
Dynamic Bond Fund	Asia Strategic Interest Bond Fund
Dynamic Bond Fund	US Short-Term Fund
Dynamic Multi-Asset Fund	PIMCO Capital Securities Fund
Dynamic Multi-Asset Fund	Income Fund
Dynamic Multi-Asset Fund	PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund
Emerging Local Bond Fund	Asia Strategic Interest Bond Fund
Emerging Local Bond Fund	Emerging Local Bond ESG Fund
Emerging Local Bond Fund	PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund
Emerging Markets Bond Fund	PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund
Euro Income Bond Fund	PIMCO European High Yield Bond Fund
Global Bond Fund	PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund
Global Bond Fund	Global Bond Ex-US Fund
Global Bond Fund	PIMCO European High Yield Bond Fund
Global Bond Fund	UK Corporate Bond Fund
Global Bond Fund	US Short-Term Fund
Global Bond ESG Fund	Global Investment Grade Credit ESG Fund
Global High Yield Bond Fund	PIMCO Asia High Yield Bond Fund
Global High Yield Bond Fund	PIMCO European High Yield Bond Fund
Global Investment Grade Credit Fund	PIMCO Asia High Yield Bond Fund
Global Investment Grade Credit Fund	Asia Strategic Interest Bond Fund
Global Investment Grade Credit Fund	PIMCO European High Yield Bond Fund
Low Average Duration Fund	US Short-Term Fund
Low Duration Opportunities Fund	PIMCO Asia High Yield Bond Fund
Low Duration Opportunities Fund	Asia Strategic Interest Bond Fund
Total Return Bond Fund	US Short-Term Fund
US High Yield Bond Fund	PIMCO Asia High Yield Bond Fund

Die folgenden Fonds hielten im Berichtszeitraum zum 30. Juni 2022 Überkreuzinvestitionen innerhalb des Umbrella-Fonds. Diese Anlagen wurden zum Zweck der Darstellung der Summe der Gesellschaft in der vergleichenden Betriebsergebnisrechnung und im Ausweis der Nettovermögensänderungen der Fonds eliminiert.

Fonds	30. Jun. 2022 Überkreuzinvestitionen innerhalb des Umbrella-Fonds
Diversified Income Fund	PIMCO Asia High Yield Bond Fund
Diversified Income Fund	Asia Strategic Interest Bond Fund
Diversified Income Fund	PIMCO European High Yield Bond Fund
Diversified Income Fund	US Short-Term Fund
Diversified Income Duration Hedged Fund	PIMCO Asia High Yield Bond Fund
Diversified Income Duration Hedged Fund	Asia Strategic Interest Bond Fund
Diversified Income Duration Hedged Fund	PIMCO European High Yield Bond Fund
Diversified Income Duration Hedged Fund	US Short-Term Fund
Dynamic Bond Fund	PIMCO Asia High Yield Bond Fund
Dynamic Bond Fund	Asia Strategic Interest Bond Fund
Dynamic Bond Fund	US Short-Term Fund
Dynamic Multi-Asset Fund	PIMCO Capital Securities Fund
Dynamic Multi-Asset Fund	Income Fund
Emerging Local Bond Fund	PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund
Emerging Local Bond Fund	Asia Strategic Interest Bond Fund
Emerging Markets Bond Fund	PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund
Emerging Markets Bond Fund	Asia Strategic Interest Bond Fund
Euro Income Bond Fund	PIMCO European High Yield Bond Fund
Euro Income Bond Fund	US Short-Term Fund
Global Bond Fund	PIMCO European High Yield Bond Fund
Global Bond Fund	Global Bond Ex-US Fund
Global Bond Fund	UK Corporate Bond Fund
Global Bond Fund	US Short-Term Fund
Global Bond ESG Fund	Global Investment Grade Credit ESG Fund
Global High Yield Bond Fund	PIMCO Asia High Yield Bond Fund
Global High Yield Bond Fund	PIMCO European High Yield Bond Fund
Global Investment Grade Credit Fund	PIMCO Asia High Yield Bond Fund
Global Investment Grade Credit Fund	Asia Strategic Interest Bond Fund
Global Investment Grade Credit Fund	PIMCO European High Yield Bond Fund
Global Libor Plus Bond Fund	PIMCO Asia High Yield Bond Fund
Global Libor Plus Bond Fund	Asia Strategic Interest Bond Fund
Low Average Duration Fund	US Short-Term Fund
Total Return Bond Fund	US Short-Term Fund
US High Yield Bond Fund	PIMCO Asia High Yield Bond Fund
US Investment Grade Corporate Bond Fund	PIMCO Asia High Yield Bond Fund
US Investment Grade Corporate Bond Fund	Asia Strategic Interest Bond Fund

Einige Fonds legen in die Z Class des PIMCO China Bond Fund (ein Teilfonds von PIMCO Specialty Funds Ireland p.l.c.) und PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (ein Teilfonds von PIMCO Select Funds plc), die als verbundene Fonds gelten. Aufgrund der Ausgestaltung des Angebots der Z Class und um doppelte Gebühren zu vermeiden, beträgt die Verwaltungsgebühr für die Z Class beider Fonds 0,00 % pro Jahr.

Einige Fonds legen in die Teilfonds von PIMCO ETFs plc an: PIMCO Euro Short-Term High Yield Corporate Bond Index UCITS ETF, PIMCO Euro Short Maturity UCITS ETF und PIMCO US Dollar Short Maturity UCITS ETF; diese gelten als verbundene Fonds. Da diese Fonds keine gebührenfreien Anteilsklassen haben, wird die Verwaltungsgebühr vom anlegenden Fonds und dem zugrunde liegenden verbundenen Zielfonds bezahlt. Ein Verzicht auf die Anlageberatungsgebühr wird daher vor der Zahlung durch den Fonds an die Verwaltungsgesellschaft ausgeglichen, was in der Betriebsergebnisrechnung innerhalb der Erstattungen der Anlageberatungsgesellschaft ausgewiesen wird.

Während der Berichtszeiträume zum 30. Juni 2023 und 30. Juni 2022 kauften und verkauften die unten angegebenen Fonds Wertpapiere verbundener Fonds und tätigten Käufe und Verkäufe in Bezug auf Überkreuzinvestitionen sowie Käufe und Verkäufe von Anlagen in verbundenen Fonds (Angaben in Tausend):

	30. Jun. 2023	
Fonds	Käufe	Verkäufe
PIMCO Asia High Yield Bond Fund	$ 423.569	$ 391.337
Asia Strategic Interest Bond Fund	92.981	99.053
PIMCO Capital Securities Fund	115.634	34.102
PIMCO Climate Bond Fund	294	5.057
Commodity Real Return Fund	549	0
PIMCO Credit Opportunities Bond Fund	6.342	6.452
Diversified Income Fund	262.747	405.020
Diversified Income Duration Hedged Fund	9.813	20.783
Diversified Income ESG Fund	5.821	833
Dynamic Bond Fund	78.348	82.000
Dynamic Multi-Asset Fund	5.681	97.503
Emerging Local Bond Fund	1.053.732	924.477
Emerging Markets Bond Fund	925.922	895.848
Emerging Markets Bond ESG Fund	12.330	11.043
Emerging Markets Corporate Bond Fund	35.549	35.460
PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund	112.961	116.241
Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund	101	199
Euro Bond Fund	53.170	107.866
Euro Credit Fund	3.412	416
Euro Income Bond Fund	3.560	25.568
Euro Long Average Duration Fund	22.448	12.114
Euro Short-Term Fund	0	19.129
PIMCO European High Yield Bond Fund	17.655	3.018
PIMCO European Short-Term Opportunities Fund	16.916	38.750
Global Advantage Fund	89.176	85.406
Global Bond Fund	611.120	554.590
Global Bond ESG Fund	11.942	7.052
Global Bond Ex-US Fund	230.398	227.009
PIMCO Global Core Asset Allocation Fund	125.641	140.601
Global High Yield Bond Fund	240.825	313.197
Global Investment Grade Credit Fund	291.803	313.554
Global Investment Grade Credit ESG Fund	106.586	14.830
Global Low Duration Real Return Fund	264.567	276.800
Global Real Return Fund	253.215	250.100
Income Fund	1.014.864	682.726
Income Fund II	60.466	54.600
Inflation Multi-Asset Fund	52.735	59.781
Low Average Duration Fund	161.690	201.129
Low Duration Global Investment Grade Credit Fund	159.590	142.383
Low Duration Income Fund	62.826	24.129
Low Duration Opportunities Fund	176.229	206.029
PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund	1.116	3.600
Mortgage Opportunities Fund	0	665
StocksPLUS™ Fund	78.848	8.600
PIMCO StocksPLUS™ AR Fund	412	200
Strategic Income Fund	110.199	116.600
Total Return Bond Fund	705.326	744.063
PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund	141.935	153.703
UK Corporate Bond Fund	13.291	7.714
UK Long Term Corporate Bond Fund	$ 12.962	$ 1.046
US High Yield Bond Fund	441.483	425.114
US Investment Grade Corporate Bond Fund	9.748	4.779
US Short-Term Fund	51.202	103.402

	30. Jun. 2022	
Fonds	Käufe	Verkäufe
PIMCO Asia High Yield Bond Fund	$ 450.898	$ 528.533
Asia Strategic Interest Bond Fund	82.359	82.711
PIMCO Capital Securities Fund	80.074	524.621
PIMCO Climate Bond Fund	449	17.338
Commodity Real Return Fund	79.289	0
PIMCO Credit Opportunities Bond Fund	3.412	5.157
Diversified Income Fund	303.492	1.096.849
Diversified Income Duration Hedged Fund	30.777	86.520
Dynamic Bond Fund	105.264	171.389
Dynamic Multi-Asset Fund	647	0
Emerging Local Bond Fund	886.434	905.374
Emerging Markets Bond Fund	476.521	763.429
Emerging Markets Bond ESG Fund	185.351	65.552
Emerging Markets Corporate Bond Fund	50.466	53.126
PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund	72.028	68.693
Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund	796	952
Euro Bond Fund	255.645	189.222
Euro Credit Fund	80.048	111.228
Euro Income Bond Fund	209.995	297.005
Euro Long Average Duration Fund	5.104	4.123
Euro Short-Term Fund	30.546	42.154
PIMCO European High Yield Bond Fund	4.107	6.694
PIMCO European Short-Term Opportunities Fund	34.936	36.870
Global Advantage Fund	91.947	77.527
Global Bond Fund	785.238	769.426
Global Bond ESG Fund	3.729	730
Global Bond Ex-US Fund	330.925	295.371
PIMCO Global Core Asset Allocation Fund	526.757	648.111
Global High Yield Bond Fund	634.659	964.028
Global Investment Grade Credit Fund	1.864.705	2.994.709
Global Investment Grade Credit ESG Fund	59.019	63.891
Global Low Duration Real Return Fund	114.718	122.898
Global Real Return Fund	352.063	281.345
Income Fund	632.501	1.884.444
Income Fund II	3.404	3.000
Inflation Multi-Asset Fund	47.808	9.500
Low Average Duration Fund	315.626	247.122
Low Duration Global Investment Grade Credit Fund	182.053	155.605
Low Duration Income Fund	115.594	151.082
Low Duration Opportunities Fund	83.207	71.406
PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund	16.121	13.400
Mortgage Opportunities Fund	826.458	912.334
StocksPLUS™ Fund	30.955	317.619
PIMCO StocksPLUS™ AR Fund	201	400
Strategic Income Fund	139.264	118.155
Total Return Bond Fund	363.416	571.790
PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund	28.707	21.000
UK Corporate Bond Fund	7.714	6.714
UK Long Term Corporate Bond Fund	6.832	10.266
US High Yield Bond Fund	720.899	966.445
US Investment Grade Corporate Bond Fund	151.908	163.585
US Short-Term Fund	415.891	385.870

In der folgenden Tabelle ist Wert der umlaufenden Anteile im Besitz der Allianz-Gruppe, von Fonds der Gesellschaft, von verbundenen Fonds und von Mitarbeitern der Anlageberatungsgesellschaften in ihrer Eigenschaft als verbundene Parteien der Gesellschaft angegeben. Dabei handelt es sich zum 30. Juni 2023 und 31. Dezember 2022 um über 20 % des Nettovermögens des Fonds.

Fonds	30. Juni 2023 % gehalten	31. Dez. 2022 % gehalten
PIMCO Asia High Yield Bond Fund	k. A.	21,53
Asia Strategic Interest Bond Fund	50,72	49,24
PIMCO Capital Securities Fund	23,13	23,94
PIMCO Climate Bond Fund	k. A.	21,78
PIMCO Credit Opportunities Bond Fund	23,15	25,65
Diversified Income ESG Fund	100,00	100,00
Dynamic Multi-Asset Fund	25,09	25,10
Emerging Local Bond ESG Fund	94,33	100,00
Emerging Markets Bond Fund	23,64	22,87
PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund	51,79	57,57
Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund	27,64	26,22
Euro Credit Fund	30,97	30,16
Euro Income Bond Fund	24,12	21,29
PIMCO European High Yield Bond Fund	68,63	98,78
PIMCO European Short-Term Opportunities Fund	24,76	31,55
Global Bond Ex-US Fund	20,34	k. A.
PIMCO Global Core Asset Allocation Fund	61,38	65,44
Income Fund II	24,31	40,67
Inflation Multi-Asset Fund	25,80	29,48
Low Duration Opportunities ESG Fund	100,00	100,00
PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund	53,38	50,65
PIMCO StocksPLUS™ AR Fund	83,32	84,86
Strategic Income Fund	46,61	47,13
PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund	20,69	k. A.
US Short-Term Fund	32,29	31,95

Zum 30. Juni 2023 hielt der Income Fund 9.694 Schuldverschreibungen (31. Dezember 2022: 9.694 Schuldverschreibungen) von BNP Paribas Issuance BV, die durch Schuldverschreibungen besichert ist, die von der Repack Bond Collateral Ltd. (die „Körperschaft“) ausgegeben werden., eine nach dem Recht der Kaimaninseln gegründete befreite Gesellschaft mit beschränkter Haftung, die eine verbundene Partei der Anlageberatungsgesellschaft ist. Es wurden keine Gebühren von der Körperschaft an die Anlageberatungsgesellschaft gezahlt.

Beteiligungen der Verwaltungsratsmitglieder und des Sekretärs an Anteilen und Verträgen

Zum 30. Juni 2023 hielt V. Mangala Ananthanarayanan 8.187,77 (31. Dezember 2022: (8.187,77) Anteile des PIMCO Asia High Yield Bond Fund, 5.319,15 (31. Dezember 2022: 5.319,15) Anteile des PIMCO Capital Securities Fund, 8.757,87 (31. Dezember 2022: 8.757,87) Anteile des Dynamic Multi-Asset Fund, 3.619,69 (31. Dezember 2022: 3.619,69) Anteile des Global Bond Fund und 27.543,65 (31. Dezember 2022: 27.543,65) Anteile des Income Fund, wobei es sich jeweils um Fonds der Gesellschaft handelt.

Zum 30. Juni 2023 hielt Ryan P. Blute 5.387,93 (31. Dezember 2022: (5.387,93) Anteile des PIMCO Asia High Yield Bond Fund, 105.514,79 (31. Dezember 2022: 24.131,27) Anteile des Low Average Duration Fund und 215.070,39 (31. Dezember 2022: 82.494,63) Anteile des Low Duration Income Fund, wobei es sich jeweils um Fonds der Gesellschaft handelt.

Zum 30. Juni 2023 hielt Craig A. Dawson 18.118,23 (31. Dezember 2022: 18.118,23) Anteile des PIMCO Capital Securities Fund, 97.370,98 (31. Dezember 2022: 97.370,98) Anteile des Low Duration Income Fund und 92.850,51 (31. Dezember 2022: 92.850,51) Anteile des Low Duration Opportunities Fund; bei allen Fonds handelt es sich um Fonds der Gesellschaft.

Zum 30. Juni 2023 hielt David M. Kennedy 4.316,08 (31. Dezember 2022: 4.449,56) Anteile des Emerging Markets Bond Fund und 16.786,79 (31. Dezember 2022: 16.786,79) Anteile des PIMCO Global Core Asset Allocation Fund. Beide sind Fonds der Gesellschaft.

Während der Berichtszeiträume zum 30. Juni 2023 oder 30. Juni 2022 hielt kein anderes Verwaltungsratsmitglied eine Beteiligung an Anteilen der Gesellschaft.

Während der Berichtszeiträume zum 30. Juni 2023 oder 30. Juni 2022 hielt der Sekretär keine Beteiligung an Anteilen der Gesellschaft.

Während der Berichtszeiträume zum 30. Juni 2023 oder zum 30. Juni 2022 beschäftigte die Gesellschaft keine Mitarbeiter.

11. TRANSAKTIONEN MIT VERBUNDENEN PERSONEN

Transaktionen, die mit der Verwaltungsgesellschaft oder Verwahrstelle eines OGAW, den Beauftragten oder Unterbeauftragten einer solchen Verwaltungsgesellschaft oder Verwahrstelle (unter Ausschluss von konzernfremden, von einer Verwahrstelle bestellten Unterverwahrstellen) oder angeschlossenen Unternehmen oder Konzerngesellschaften einer solchen Verwaltungsgesellschaft, Verwahrstelle oder von entsprechenden Beauftragten oder Unterbeauftragten („verbundene Personen“) durchgeführt werden, müssen so durchgeführt werden, als wären sie sie unter gewöhnlichen geschäftlichen Bedingungen ausgehandelt worden, und nur dann, wenn sie im besten Interesse der Anteilinhaber sind. Der Verwaltungsrat ist davon überzeugt, dass Vorkehrungen (durch schriftliche Verfahren nachgewiesen) getroffen wurden, um sicherzustellen, dass Transaktionen mit verbundenen Parteien wie oben beschrieben durchgeführt werden, und dass diese Vorkehrungen während des Berichtszeitraums eingehalten wurden.

12. WECHSELKURSE

Um einen gemeinsamen Abschluss für die Fonds und Finanzdaten für die Gesellschaft zu erhalten (was nach irischem Gesellschaftsrecht erforderlich ist), wurden die Beträge in der Aufstellung der Aktiva und Passiva zu dem am 30. Juni 2023 geltenden Wechselkurs von Euro in US-Dollar (USD/0,91659 EUR) (31. Dezember 2022: USD/0,93699 EUR) und von Pfund Sterling in US-Dollar (USD/0,78657 GBP) (31. Dezember 2022: USD/0,83132 GBP) umgerechnet. Die Beträge in der Betriebsergebnisrechnung und im Ausweis der Veränderungen im Nettovermögen wurden zu einem durchschnittlichen, für den Berichtszeitraum zum 30. Juni 2023 geltenden Wechselkurs von Euro in US-Dollar (USD/0,92567 EUR) (30. Juni 2022: USD/0,91527 EUR) und von Pfund Sterling in US-Dollar (USD/0,81121 GBP) (30. Juni 2022: USD/0,77097 GBP) umgerechnet.

In der folgenden Tabelle sind die Wechselkurse angegeben, die zur Umrechnung der Anlagen und sonstigen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten, die auf von der Funktionswährung des jeweiligen Fonds abweichende Währungen lauten, in Pfund Sterling, Euro und US-Dollar (die Funktionswährungen von Fonds der Gesellschaft) verwendet wurden.

Der Wechselkurs für den Argentinischen Peso („ARS“) zum 30. Juni 2023 enthält einen 97%igen Abschlag (31. Dezember 2022: 83 %) aufgrund der Abweichung zwischen dem offiziellen und dem inoffiziellen Wechselkurs Argentiniens.

Fremd-währung	30. Juni 2023 Präsentationswährung EUR	GBP	USD
AED	k. A.	k. A.	3,67305
ARS	280,08777	k. A.	256,72565
AUD	1,63900	1,90994	1,50229
BRL	5,26299	k. A.	4,82400
CAD	1,44367	1,68231	1,32325
CHF	0,97606	k. A.	0,89465
CLP	875,14592	k. A.	802,15000
CNH	7,93681	9,24882	7,27480
CNY	7,92508	k. A.	7,26405
COP	4555,77194	k. A.	4175,77500
CZK	23,75855	k. A.	21,77685
DKK	7,44591	8,67678	6,82485
DOP	k. A.	k. A.	55,09000
EGP	k. A.	k. A.	30,90000
EUR (or €)	k. A.	1,16531	0,91659
GBP (or £)	0,85814	1,00000	0,78657
GHS	k. A.	k. A.	11,37500
HKD	8,54973	k. A.	7,83660
HUF	373,00014	k. A.	341,88820
IDR	16356,82257	k. A.	14992,50000
ILS	4,04865	k. A.	3,71095
INR	89,50158	k. A.	82,03625
JPY (or ¥)	157,68773	183,75468	144,53500
KES	k. A.	k. A.	140,60000
KRW	1437,55660	k. A.	1317,65000
KZT	k. A.	k. A.	450,85500
MXN	18,71120	21,80430	17,15050

Fremd-währung	30. Juni 2023 Präsentationswährung EUR	GBP	USD
MYR	k. A.	k. A.	4,66750
NGN	k. A.	k. A.	765,50000
NOK	11,68849	13,62068	10,71355
NZD	1,78079	2,07517	1,63225
PEN	3,95466	k. A.	3,62480
PHP	k. A.	k. A.	55,19950
PLN	4,43268	k. A.	4,06295
RON	k. A.	k. A.	4,54560
RSD	k. A.	k. A.	107,50000
RUB	97,64453	k. A.	89,50000
SEK	11,78422	13,73224	10,80130
SGD	1,47651	1,72058	1,35335
THB	k. A.	k. A.	35,45500
TRY	28,44238	33,14411	26,07000
TWD	33,97866	k. A.	31,14450
UGX	k. A.	k. A.	3675,00000
USD (or $)	1,09100	1,27135	1,00000
UYU	k. A.	k. A.	37,37500
VND	k. A.	k. A.	23585,00000
ZAR	20,61036	24,01740	18,89125
ZMW	k. A.	k. A.	17,57500

Fremd-währung	31. Dez. 2022 Präsentationswährung EUR	GBP	USD
AED	k. A.	k. A.	3,67265
ARS	346,74937	k. A.	324,90000
AUD	1,57377	1,77380	1,47460
BRL	5,63481	k. A.	5,27975
CAD	1,44607	1,62987	1,35495
CHF	0,98742	k. A.	0,92520
CLP	909,24323	k. A.	851,95000
CNH	7,38414	8,32269	6,91885
CNY	7,41920	8,36220	6,95170
COP	5.174,97022	k. A.	4.848,88500
CZK	24,15399	k. A.	22,63200
DKK	7,43643	8,38163	6,96785
DOP	k. A.	k. A.	56,22000
EGP	k. A.	k. A.	24,75500
EUR (or €)	1,00000	1,12710	0,93699
GBP (or £)	0,88723	1,00000	0,83132
GHS	k. A.	k. A.	10,20000
HKD	8,32983	k. A.	7,80495
HUF	400,44985	k. A.	375,21670
IDR	16.614,40701	k. A.	15.567,50000
ILS	3,76579	k. A.	3,52850
INR	88,29355	k. A.	82,73000
JPY (or ¥)	140,81824	158,71670	131,94500
KES	k. A.	k. A.	123,40000
KRW	1.349,53703	k. A.	1.264,50000
KZT	k. A.	k. A.	462,72000
MXN	20,79776	23,44122	19,48725
MYR	k. A.	k. A.	4,40500
NGN	k. A.	k. A.	460,75000
NOK	10,51348	11,84977	9,85100
NZD	1,68748	1,90197	1,58115
PEN	4,06996	k. A.	3,81350
PHP	k. A.	k. A.	55,72750
PLN	4,68122	k. A.	4,38625
RON	k. A.	k. A.	4,63605
RSD	k. A.	k. A.	109,92500
RUB	77,90922	k. A.	73,00000
SEK	11,12021	12,53362	10,41950
SGD	1,43140	1,61333	1,34120

Fremd-währung	31. Dez. 2022 Präsentationswährung EUR	GBP	USD
THB	k. A.	k. A.	34,63500
TRY	19,97838	22,51769	18,71950
TWD	32,80245	k. A.	30,73550
UGX	k. A.	k. A.	3.720,00000
USD (or $)	1,06725	1,20290	1,00000
UYU	k. A.	k. A.	39,76500
VND	k. A.	k. A.	23.575,00000
ZAR	18,15925	k. A.	17,01500
ZMW	k. A.	k. A.	18,07500

13. FINANZIELLE RISIKEN

Durch ihre Aktivitäten sind die Fonds verschiedenen finanziellen Risiken ausgesetzt, z. B. dem Marktrisiko (einschließlich Preisrisiko, Zinsrisiko und Währungsrisiko), dem Kreditrisiko und dem Liquiditätsrisiko.

Der allgemeine Risikomanagementprozess für die Fonds konzentriert sich auf die Unvorhersehbarkeit der Finanzmärkte und versucht, potenziell nachteilige Effekte auf die finanzielle Entwicklung der Fonds zu minimieren. Weitere Einzelheiten zu den verschiedenen Risiken, denen der Fonds ausgesetzt sein kann, finden Sie im Prospekt.

Die Zielsetzungen und Richtlinien des Finanzrisikomanagements der Gesellschaft entsprechen auch weiterhin denjenigen, die im geprüften Jahresabschluss der Gesellschaft für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 angegeben sind.

14. TRANSAKTIONEN MIT VERBUNDENEN PERSONEN FÜR DIE IN HONGKONG VERTRIEBENEN FONDS

Verbundene Personen der Verwaltungsgesellschaft, der Anlageberatungsgesellschaften und/oder der Unter-Anlageberatungsgesellschaften, der Verwahrstelle und der Verwaltungsratsmitglieder der Gesellschaft sind jene, die im Code on Unit Trusts and Mutual Funds der Securities and Futures Commission of Hong Kong (der „SFC-Code“) definiert sind. Alle Transaktionen, die während des Geschäftsjahres zwischen den durch die SFC zugelassenen Fonds („durch die SFC zugelassene Fonds“), wie im Abschnitt zu den allgemeinen Merkmalen des Halbjahresberichts beschrieben, und der Verwaltungsgesellschaft, den Anlageberatungsgesellschaften und/oder den Unter-Anlageberatungsgesellschaften, der Verwahrstelle und den Verwaltungsratsmitglieder der Gesellschaft sowie deren jeweiligen verbundenen Personen eingegangen wurden, wurden im Rahmen der normalen Geschäftstätigkeit und zu den üblichen Geschäftsbedingungen abgeschlossen.

Die folgenden Transaktionen wurden in den Berichtszeiträumen zum 30. Juni 2023 und 30. Juni 2022 über einen Broker ausgeführt, bei dem es sich um eine verbundene Person der Verwaltungsgesellschaft, der Anlageberatungsgesellschaften und/oder der Unter-Anlageberatungsgesellschaften, der Verwahrstelle und der Verwaltungsratsmitglieder der Gesellschaft handelt:

Fonds	30. Jun. 2023 Summe Käufe und Verkäufe ('000)	% der Summe Käufe und Verkäufe	30. Jun. 2022 Summe Käufe und Verkäufe ('000)	% der Summe Käufe und Verkäufe
PIMCO Asia High Yield Bond Fund	$ 6.172.015	30,52	$ 14.107.219	32,23
Asia Strategic Interest Bond Fund	153.280	12,91	416.002	20,01
Commodity Real Return Fund	528.194	2,04	1.806.911	5,27
Diversified Income Fund	11.268.415	3,34	9.713.714	6,03
Emerging Local Bond Fund	863.206	2,11	1.380.942	3,20
Emerging Markets Bond Fund	844.035	5,55	1.558.214	7,00
Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund	53.663	2,76	40.078	5,17
Global Bond Fund	6.877.936	2,10	2.405.893	1,08
Global High Yield Bond Fund	903.931	4,69	791.283	2,95
Global Investment Grade Credit Fund	5.551.222	3,04	1.014.463	0,97
Global Real Return Fund	356.843	0,81	569.391	0,71

Fonds	30. Jun. 2023 Summe Käufe und Verkäufe ('000)	30. Jun. 2023 % der Summe Käufe und Verkäufe	30. Jun. 2022 Summe Käufe und Verkäufe ('000)	30. Jun. 2022 % der Summe Käufe und Verkäufe
Income Fund	$ 248.076.525	12,74	$ 12.902.695	1,00
Income Fund II	3.030	0,41	214	0,07
Low Average Duration Fund	689.689	4,27	1.304.128	2,66
Total Return Bond Fund	1.936.170	3,62	1.095.290	1,49
US High Yield Bond Fund	886.047	16,59	705.505	6,87

In der folgenden Tabelle wurde in den Berichtszeiträumen zum 30. Juni 2023 und 30. Juni 2022 keine Provision für die Transaktionen erhoben.

Weitere Einzelheiten zu Aktien zum 30. Juni 2023 und 31. Dezember 2022 durch Verwaltungsratsmitglieder der Gesellschaft in durch die SFC zugelassenen Fonds gehalten wurden, finden Sie in Erläuterung 10. Weitere Einzelheiten zu den Gebühren, die in den Berichtszeiträumen zum 30. Juni 2023 und 30. Juni 2022 an Verwaltungsratsmitglieder der Gesellschaft gezahlt wurden, finden Sie in Erläuterung 9.

Einzelheiten zum Wert der umlaufenden Anteile, die in den Geschäftsjahren zum 30. Juni 2023 und 31. Dezember 2022 durch verbundene Personen der Verwaltungsgesellschaft, der Anlageberatungsgesellschaften und/oder der Unter-Anlageberatungsgesellschaften gehalten wurden und über 20 % des Nettovermögens von durch die SFC zugelassenen Fonds betragen, sind Erläuterung 10 zu entnehmen. Einzelheiten zu Gebühren, die an die Verwaltungsgesellschaft, die Anlageberatungsgesellschaften und/oder Unter-Anlageberatungsgesellschaften gezahlt wurden, sind Erläuterung 9 und der Betriebsergebnisrechnung zu entnehmen.

Verwaltungsratsmitglieder und leitende Angestellte der Verwahrstelle hielten in den Berichtszeiträumen zum 30. Juni 2023 und 30. Juni 2022 keine Anteile der durch die SFC zugelassenen Fonds. Wie in Erläuterung 9 angegeben, wurden die Gebühren und Aufwendungen der Verwahrstelle durch die Verwaltungsgesellschaft aus der Verwaltungsgebühr oder durch die Anlageberatungsgesellschaften gezahlt. Alle Bankguthaben der durch die SFC zugelassenen Fonds werden entweder von State Street Bank and Trust Co. als Beauftragte der Verwahrstelle oder direkt bei einer Unterverwahrstelle gehalten. Gegebenenfalls wurden den durch die SFC zugelassenen Fonds durch die Verwahrstelle Zinsen auf diese Barsalden gezahlt oder berechnet.

15. GRUNDKAPITAL

(a) Genehmigte Anteile

Das genehmigte Grundkapital der Gesellschaft beträgt 38.092 EUR und ist in 30.000 Zeichneranteile zu je 1,27 EUR und 500.000.000.000 gewinnberechtigte Aktien ohne Nennwert aufgeteilt, die ursprünglich als „nicht klassifizierte Anteile" bezeichnet wurden.

(b) Zeichneranteile

Bis auf sieben sind die ursprünglichen 30.000 Zeichneranteile zurückgenommen worden. Die Zeichneranteile sind nicht Bestandteil des NIW der Gesellschaft und werden daher im Abschluss nur in Form dieser Erläuterung erwähnt. Nach Ansicht des Verwaltungsrates geben diese Offenlegungen die Art des Geschäftes der Gesellschaft als Investmentfonds wieder.

(c) Rückgabe- und gewinnberechtigte Anteile

Das ausgegebene gewinnberechtigte Grundkapital entspricht jederzeit dem NIW der Fonds. Rückgabe- und gewinnberechtigte Anteile werden auf Antrag des Anteilinhabers zurückgenommen und sind als Finanzverbindlichkeiten klassifiziert.

16. NETTOINVENTARWERTE

Im Folgenden sind das rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhabern zuzuschreibende Nettovermögen der einzelnen Fonds, die ausgegebenen und umlaufenden Anteile und der Nettoinventarwert (NIW) je Anteil der letzten drei Jahre (Angaben in Tausend, ausgenommen Beträge je Anteil) aufgeführt. Der in diesem Abschluss angegebene NIW je Anteil kann gemäß FRS 102 erforderliche Anpassungen enthalten. Diese können dazu führen, dass die NIW oder Gesamtrenditen der Anteilinhaber von denjenigen abweichen, die in diesem Abschluss angegeben sind. Das Nettovermögen geteilt durch die Anzahl der ausgegebenen und umlaufenden Anteile kann vom NIW aufgrund gerundeter Werte abweichen:

	Zum 30. Jun. 2023	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021
	PIMCO Asia High Yield Bond Fund		
Nettovermögen	$ 2.796.171	$ 2.981.392	$ 3.411.923
Institutional:			
thesaurierend	$ 1.649.343	$ 1.552.047	$ 1.221.240
ausgegebene und umlaufende Anteile	186.773	174.453	117.953
NIW je Anteil	$ 8,83	$ 8,90	$ 10,35
Erträge	$ 113.417	$ 113.734	$ 248.734
ausgegebene und umlaufende Anteile	16.783	16.032	28.125
NIW je Anteil	$ 6,76	$ 7,09	$ 8,84
Institutional AUD (Hedged):			
Erträge	AUD 2.594	AUD 203.422	AUD 12
ausgegebene und umlaufende Anteile	385	28.372	1
NIW je Anteil	AUD 6,74	AUD 7,17	AUD 9,00
Institutional CHF (Hedged):			
thesaurierend	CHF 3.602	CHF 4.094	CHF 35.166
ausgegebene und umlaufende Anteile	477	527	3.797
NIW je Anteil	CHF 7,55	CHF 7,77	CHF 9,26
Erträge	CHF 1.773	CHF 1.912	CHF 5.135
ausgegebene und umlaufende Anteile	279	281	591
NIW je Anteil	CHF 6,35	CHF 6,81	CHF 8,69
Institutional EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 384.379	€ 498.977	€ 653.189
ausgegebene und umlaufende Anteile	50.131	63.739	70.200
NIW je Anteil	€ 7,67	€ 7,83	€ 9,30
Erträge	€ 21.934	€ 27.728	€ 75.650
ausgegebene und umlaufende Anteile	3.413	4.056	8.695
NIW je Anteil	€ 6,43	€ 6,84	€ 8,70
Institutional GBP (Hedged):			
thesaurierend	£ 14.268	£ 14.369	£ 18.246
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.845	1.836	1.996
NIW je Anteil	£ 7,73	£ 7,83	£ 9,14
Erträge	£ 17.753	£ 20.785	£ 59.979
ausgegebene und umlaufende Anteile	2.764	3.068	7.061
NIW je Anteil	£ 6,42	£ 6,77	£ 8,50
Institutional RMB (Hedged):			
Erträge	k. A.	k. A.	CNH 61
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	k. A.	1
NIW je Anteil	k. A.	k. A.	CNH 91,17
Institutional SGD (Hedged):			
Erträge	SGD 2.479	SGD 385	SGD 85
ausgegebene und umlaufende Anteile	363	53	9
NIW je Anteil	SGD 6,84	SGD 7,23	SGD 9,01
Investor:			
thesaurierend	$ 6.300	$ 8.727	$ 19.282
ausgegebene und umlaufende Anteile	848	1.164	2.201
NIW je Anteil	$ 7,43	$ 7,50	$ 8,76
Erträge	$ 54.081	$ 71.688	$ 273.632
ausgegebene und umlaufende Anteile	8.161	10.304	31.566
NIW je Anteil	$ 6,63	$ 6,96	$ 8,67
Investor AUD (Hedged):			
Erträge	AUD 3.720	AUD 3.889	AUD 5.081
ausgegebene und umlaufende Anteile	567	557	579
NIW je Anteil	AUD 6,57	AUD 6,99	AUD 8,77

	Zum 30. Jun. 2023	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021
	PIMCO Asia High Yield Bond Fund (Fortsetzung)		
Investor EUR (Hedged):			
Erträge	€ 1.013	€ 873	€ 935
ausgegebene und umlaufende Anteile	161	130	110
NIW je Anteil	€ 6,29	€ 6,69	€ 8,52
Investor RMB (Hedged):			
Erträge	CNH 10.329	CNH 13.234	CNH 24.873
ausgegebene und umlaufende Anteile	151	182	275
NIW je Anteil	CNH 68,20	CNH 72,74	CNH 90,46
Investor SGD (Hedged):			
Erträge	SGD 4.259	SGD 4.112	SGD 6.528
ausgegebene und umlaufende Anteile	647	591	753
NIW je Anteil	SGD 6,58	SGD 6,96	SGD 8,67
Administrative:			
Erträge	$ 25.777	$ 28.245	$ 41.320
ausgegebene und umlaufende Anteile	3.813	3.980	4.672
NIW je Anteil	$ 6,76	$ 7,10	$ 8,84
E Class:			
thesaurierend	$ 57.852	$ 61.585	$ 78.405
ausgegebene und umlaufende Anteile	7.168	7.540	8.175
NIW je Anteil	$ 8,07	$ 8,17	$ 9,59
Erträge	$ 56.607	$ 56.633	$ 100.159
ausgegebene und umlaufende Anteile	8.375	7.981	11.325
NIW je Anteil	$ 6,76	$ 7,10	$ 8,84
E Class CHF (Hedged):			
thesaurierend	CHF 913	CHF 1.012	CHF 1.263
ausgegebene und umlaufende Anteile	124	133	138
NIW je Anteil	CHF 7,37	CHF 7,63	CHF 9,16
Erträge	CHF 206	CHF 245	CHF 280
ausgegebene und umlaufende Anteile	33	36	32
NIW je Anteil	CHF 6,35	CHF 6,81	CHF 8,69
E Class EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 45.006	€ 48.877	€ 61.580
ausgegebene und umlaufende Anteile	6.010	6.365	6.687
NIW je Anteil	€ 7,49	€ 7,68	€ 9,21
Erträge	€ 9.724	€ 8.314	€ 10.041
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.513	1.217	1.154
NIW je Anteil	€ 6,42	€ 6,83	€ 8,70
E Class HKD (Unhedged):			
Erträge	HKD 5.515	HKD 6.334	HKD 4.540
ausgegebene und umlaufende Anteile	816	897	516
NIW je Anteil	HKD 6,76	HKD 7,06	HKD 8,79
E Class SGD (Hedged):			
Erträge	SGD 14.008	SGD 15.239	SGD 25.623
ausgegebene und umlaufende Anteile	2.106	2.168	2.924
NIW je Anteil	SGD 6,65	SGD 7,03	SGD 8,76
H Institutional:			
thesaurierend	$ 1.312	$ 1.323	$ 182
ausgegebene und umlaufende Anteile	172	172	20
NIW je Anteil	$ 7,62	$ 7,69	$ 8,96
Erträge	$ 534	$ 547	$ 686
ausgegebene und umlaufende Anteile	81	79	80
NIW je Anteil	$ 6,57	$ 6,90	$ 8,60
M Retail:			
ausschüttend II	$ 21.565	$ 17.613	$ 22.700
ausgegebene und umlaufende Anteile	3.415	2.637	2.684
NIW je Anteil	$ 6,32	$ 6,68	$ 8,46
M Retail HKD (Unhedged):			
ausschüttend II	HKD 3.879	HKD 1.797	HKD 6.482
ausgegebene und umlaufende Anteile	615	270	771
NIW je Anteil	HKD 6,30	HKD 6,65	HKD 8,41

	Zum 30. Jun. 2023	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021
	PIMCO Asia High Yield Bond Fund (Fortsetzung)		
M Retail SGD (Hedged):			
ausschüttend II	SGD 8.109	SGD 8.881	SGD 11.492
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.305	1.342	1.372
NIW je Anteil	SGD 6,21	SGD 6,62	SGD 8,38
Z Class:			
thesaurierend	$ 229.170	$ 230.136	$ 300.885
ausgegebene und umlaufende Anteile	25.207	25.207	28.503
NIW je Anteil	$ 9,09	$ 9,13	$ 10,56
	Asia Strategic Interest Bond Fund		
Nettovermögen	$ 319.819	$ 313.987	$ 361.011
Institutional:			
thesaurierend	$ 11	k. A.	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	1	k. A.	k. A.
NIW je Anteil	$ 9,95	k. A.	k. A.
Erträge	$ 53.839	$ 54.459	$ 64.997
ausgegebene und umlaufende Anteile	6.797	6.776	6.958
NIW je Anteil	$ 7,92	$ 8,04	$ 9,34
Institutional EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 9	k. A.	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	1	k. A.	k. A.
NIW je Anteil	€ 9,91	k. A.	k. A.
Erträge	€ 98.102	€ 97.916	€ 102.975
ausgegebene und umlaufende Anteile	12.864	12.495	11.068
NIW je Anteil	€ 7,63	€ 7,84	€ 9,30
Institutional GBP (Hedged):			
Erträge	£ 315	£ 205	£ 174
ausgegebene und umlaufende Anteile	40	26	19
NIW je Anteil	£ 7,88	£ 8,04	£ 9,41
Institutional SGD (Hedged):			
Erträge	SGD 7.861	SGD 3.799	SGD 5.354
ausgegebene und umlaufende Anteile	987	467	566
NIW je Anteil	SGD 7,96	SGD 8,13	SGD 9,46
Investor:			
thesaurierend	$ 10	k. A.	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	1	k. A.	k. A.
NIW je Anteil	$ 9,95	k. A.	k. A.
Investor EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 9	k. A.	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	1	k. A.	k. A.
NIW je Anteil	€ 9,90	k. A.	k. A.
E Class:			
thesaurierend	$ 2.846	$ 806	$ 12
ausgegebene und umlaufende Anteile	327	94	1
NIW je Anteil	$ 8,69	$ 8,62	$ 9,69
Erträge	$ 21.585	$ 24.409	$ 24.934
ausgegebene und umlaufende Anteile	3.098	3.450	3.015
NIW je Anteil	$ 6,97	$ 7,08	$ 8,27
E Class EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 6.035	€ 5.640	€ 5.060
ausgegebene und umlaufende Anteile	731	680	532
NIW je Anteil	€ 8,26	€ 8,29	€ 9,51
E Class EUR (Unhedged):			
thesaurierend	€ 19.906	€ 21.244	€ 25.443
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.425	1.500	1.703
NIW je Anteil	€ 13,97	€ 14,17	€ 14,94
E Class HKD (Unhedged):			
Erträge	HKD 2.970	HKD 2.973	HKD 3.401
ausgegebene und umlaufende Anteile	372	367	362
NIW je Anteil	HKD 7,99	HKD 8,09	HKD 9,40

	Zum 30. Jun. 2023		Zum 31. Dez. 2022		Zum 31. Dez. 2021	
	Asia Strategic Interest Bond Fund (Fortsetzung)					
E Class SGD (Hedged):						
Erträge	SGD	2.948	SGD	300	SGD	337
ausgegebene und umlaufende Anteile		371		37		36
NIW je Anteil	SGD	7,95	SGD	8,13	SGD	9,46
M Retail HKD (Unhedged):						
Erträge	HKD	29.970	HKD	31.879	HKD	39.857
ausgegebene und umlaufende Anteile		4.921		5.174		5.540
NIW je Anteil	HKD	6,09	HKD	6,16	HKD	7,19
Z Class:						
thesaurierend	$	93.585	$	93.351	$	109.270
ausgegebene und umlaufende Anteile		10.471		10.610		11.219
NIW je Anteil	$	8,94	$	8,80	$	9,74
	PIMCO Capital Securities Fund					
Nettovermögen	$	5.450.002	$	5.721.591	$	9.110.409
Institutional:						
thesaurierend	$	1.300.577	$	1.352.729	$	2.296.596
ausgegebene und umlaufende Anteile		67.278		69.143		103.846
NIW je Anteil	$	19,33	$	19,56	$	22,12
Erträge	$	271.371	$	393.584	$	728.260
ausgegebene und umlaufende Anteile		28.509		39.825		62.402
NIW je Anteil	$	9,52	$	9,88	$	11,67
Institutional AUD (Hedged):						
Erträge		k. A.		k. A.	AUD	14
ausgegebene und umlaufende Anteile		k. A.		k. A.		1
NIW je Anteil		k. A.		k. A.	AUD	9,90
Institutional BRL (Hedged):						
thesaurierend	$	12.281	$	25.163	$	47.342
ausgegebene und umlaufende Anteile		1.326		3.040		5.855
NIW je Anteil	$	9,26	$	8,28	$	8,09
Institutional CHF (Hedged):						
thesaurierend	CHF	37.804	CHF	52.485	CHF	120.911
ausgegebene und umlaufende Anteile		2.588		3.478		6.908
NIW je Anteil	CHF	14,61	CHF	15,09	CHF	17,50
Institutional EUR (Hedged):						
thesaurierend	€	1.176.914	€	1.198.101	€	1.868.333
ausgegebene und umlaufende Anteile		88.625		88.171		118.946
NIW je Anteil	€	13,28	€	13,59	€	15,71
Erträge	€	415.915	€	383.951	€	481.884
ausgegebene und umlaufende Anteile		41.983		36.928		38.373
NIW je Anteil	€	9,91	€	10,40	€	12,56
ausschüttend II	€	5.762	€	31.417	€	41.671
ausgegebene und umlaufende Anteile		769		3.979		4.334
NIW je Anteil	€	7,49	€	7,89	€	9,61
Institutional GBP (Hedged):						
thesaurierend	£	53.481	£	35.494	£	43.301
ausgegebene und umlaufende Anteile		3.852		2.518		2.696
NIW je Anteil	£	13,89	£	14,10	£	16,06
Erträge	£	66.500	£	67.663	£	106.976
ausgegebene und umlaufende Anteile		6.300		6.132		8.135
NIW je Anteil	£	10,56	£	11,03	£	13,15

	Zum 30. Jun. 2023		Zum 31. Dez. 2022		Zum 31. Dez. 2021	
	PIMCO Capital Securities Fund (Fortsetzung)					
Institutional RMB (Hedged):						
Erträge		k. A.		k. A.	CNH	66
ausgegebene und umlaufende Anteile		k. A.		k. A.		1
NIW je Anteil		k. A.		k. A.	CNH	100,31
Institutional SGD (Hedged):						
Erträge	SGD	1.030	SGD	178	SGD	39
ausgegebene und umlaufende Anteile		128		21		4
NIW je Anteil	SGD	8,03	SGD	8,38	SGD	9,91
Investor:						
thesaurierend	$	192.193	$	215.127	$	345.234
ausgegebene und umlaufende Anteile		14.647		16.173		22.879
NIW je Anteil	$	13,12	$	13,30	$	15,09
Erträge	$	47.976	$	72.649	$	245.968
ausgegebene und umlaufende Anteile		5.063		7.387		21.180
NIW je Anteil	$	9,47	$	9,84	$	11,61
Investor AUD (Hedged):						
Erträge	AUD	13.846	AUD	12.971	AUD	26.915
ausgegebene und umlaufende Anteile		1.605		1.437		2.496
NIW je Anteil	AUD	8,63	AUD	9,03	AUD	10,79
Investor CAD (Hedged):						
Erträge	CAD	3.961	CAD	4.043	CAD	4.771
ausgegebene und umlaufende Anteile		441		432		431
NIW je Anteil	CAD	8,99	CAD	9,35	CAD	11,08
Investor EUR (Hedged):						
thesaurierend	€	21.230	€	23.367	€	49.337
ausgegebene und umlaufende Anteile		1.842		1.978		3.601
NIW je Anteil	€	11,53	€	11,81	€	13,70
Investor GBP (Hedged):						
Erträge	£	2.992	£	2.695	£	3.470
ausgegebene und umlaufende Anteile		368		319		344
NIW je Anteil	£	8,13	£	8,46	£	10,08
Investor RMB (Hedged):						
Erträge		k. A.	CNH	31.763	CNH	39.482
ausgegebene und umlaufende Anteile		k. A.		313		330
NIW je Anteil		k. A.	CNH	101,51	CNH	119,51
Investor SGD (Hedged):						
Erträge	SGD	5.179	SGD	5.849	SGD	5.321
ausgegebene und umlaufende Anteile		582		630		484
NIW je Anteil	SGD	8,90	SGD	9,29	SGD	10,99
Administrative:						
thesaurierend	$	136.237	$	141.400	$	149.168
ausgegebene und umlaufende Anteile		7.428		7.599		7.057
NIW je Anteil	$	18,34	$	18,61	$	21,14
Erträge	$	79.749	$	98.383	$	140.861
ausgegebene und umlaufende Anteile		6.230		7.402		8.978
NIW je Anteil	$	12,80	$	13,29	$	15,69
ausschüttend II	$	10	$	10		k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile		1		1		k. A.
NIW je Anteil	$	9,19	$	9,60		k. A.
Administrative EUR (Hedged):						
thesaurierend	€	13.978	€	13.449	€	18.966
ausgegebene und umlaufende Anteile		899		843		1.024
NIW je Anteil	€	15,55	€	15,95	€	18,53
Administrative SGD (Hedged):						
ausschüttend II	SGD	13	SGD	14		k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile		1		1		k. A.
NIW je Anteil	SGD	9,13	SGD	9,59		k. A.
E Class:						
thesaurierend	$	322.450	$	352.622	$	452.418
ausgegebene und umlaufende Anteile		23.981		25.798		29.018
NIW je Anteil	$	13,45	$	13,67	$	15,59

	Zum 30. Jun. 2023		Zum 31. Dez. 2022		Zum 31. Dez. 2021	
	PIMCO Capital Securities Fund (Fortsetzung)					
Erträge	$	60.793	$	64.556	$	99.264
ausgegebene und umlaufende Anteile		6.408		6.556		8.539
NIW je Anteil	$	9,49	$	9,85	$	11,62
E Class CHF (Hedged): thesaurierend	CHF	7.449	CHF	8.252	CHF	11.446
ausgegebene und umlaufende Anteile		743		793		940
NIW je Anteil	CHF	10,03	CHF	10,41	CHF	12,18
E Class EUR (Hedged): thesaurierend	€	418.303	€	402.295	€	497.935
ausgegebene und umlaufende Anteile		36.492		34.146		36.232
NIW je Anteil	€	11,46	€	11,78	€	13,74
Erträge	€	62.231	€	62.789	€	73.090
ausgegebene und umlaufende Anteile		7.625		7.332		7.069
NIW je Anteil	€	8,16	€	8,56	€	10,34
M Retail: ausschüttend II	$	202.342	$	218.883	$	306.306
ausgegebene und umlaufende Anteile		24.108		24.922		29.067
NIW je Anteil	$	8,39	$	8,78	$	10,54
M Retail HKD (Unhedged): Erträge	HKD	2.710	HKD	2.801	HKD	24.499
ausgegebene und umlaufende Anteile		298		298		2.211
NIW je Anteil	HKD	9,10	HKD	9,40	HKD	11,08
M Retail SGD (Hedged): ausschüttend II	SGD	90.625	SGD	100.715	SGD	145.278
ausgegebene und umlaufende Anteile		11.028		11.653		13.981
NIW je Anteil	SGD	8,22	SGD	8,64	SGD	10,39
R Class: Erträge	$	4.322	$	4.980	$	6.177
ausgegebene und umlaufende Anteile		452		501		526
NIW je Anteil	$	9,57	$	9,94	$	11,73
R Class EUR (Hedged): Erträge	€	3.129	€	3.708	€	12.422
ausgegebene und umlaufende Anteile		394		445		1.233
NIW je Anteil	€	7,94	€	8,33	€	10,07
R Class GBP (Hedged): Erträge	£	2.450	£	2.795	£	5.957
ausgegebene und umlaufende Anteile		288		315		564
NIW je Anteil	£	8,51	£	8,86	£	10,56
T Class: Erträge	$	7.991	$	8.517	$	11.570
ausgegebene und umlaufende Anteile		817		839		966
NIW je Anteil	$	9,78	$	10,15	$	11,98
T Class EUR (Hedged): thesaurierend	€	62.881	€	65.092	€	84.896
ausgegebene und umlaufende Anteile		6.075		6.106		6.800
NIW je Anteil	€	10,35	€	10,66	€	12,48
Z Class: Erträge	$	88.523	$	78.203	$	124.585
ausgegebene und umlaufende Anteile		8.463		7.202		9.705
NIW je Anteil	$	10,46	$	10,86	$	12,84
Z Class AUD (Hedged): Erträge	AUD	75.526	AUD	104.790	AUD	127.724
ausgegebene und umlaufende Anteile		8.302		11.002		11.223
NIW je Anteil	AUD	9,10	AUD	9,52	AUD	11,38
	PIMCO Climate Bond Fund					
Nettovermögen	$	289.524	$	292.655	$	328.081
Institutional: thesaurierend	$	24.922	$	27.502	$	21.317
ausgegebene und umlaufende Anteile		2.764		3.116		2.108
NIW je Anteil	$	9,02	$	8,83	$	10,11

	Zum 30. Jun. 2023		Zum 31. Dez. 2022		Zum 31. Dez. 2021	
	PIMCO Climate Bond Fund (Fortsetzung)					
Institutional AUD (Hedged): Erträge	AUD	375		k. A.		k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile		38		k. A.		k. A.
NIW je Anteil	AUD	9,89		k. A.		k. A.
Institutional CHF (Hedged): thesaurierend	CHF	743	CHF	940	CHF	1.103
ausgegebene und umlaufende Anteile		88		112		111
NIW je Anteil	CHF	8,43	CHF	8,42	CHF	9,91
Institutional EUR (Hedged): thesaurierend	€	43.163	€	62.757	€	80.658
ausgegebene und umlaufende Anteile		5.003		7.351		8.066
NIW je Anteil	€	8,63	€	8,54	€	10,00
Erträge	€	103.157	€	73.780	€	101.819
ausgegebene und umlaufende Anteile		12.550		8.951		10.361
NIW je Anteil	€	8,22	€	8,24	€	9,83
Institutional GBP (Hedged): thesaurierend	£	29.465	£	32.441	£	28.217
ausgegebene und umlaufende Anteile		3.323		3.720		2.799
NIW je Anteil	£	8,87	£	8,72	£	10,08
Erträge	£	34.174	£	25.204	£	715
ausgegebene und umlaufende Anteile		4.035		2.978		72
NIW je Anteil	£	8,47	£	8,46	£	9,97
Institutional SEK (Hedged): thesaurierend	SEK	17.101	SEK	290.215	SEK	292.047
ausgegebene und umlaufende Anteile		198		3.406		2.939
NIW je Anteil	SEK	86,16	SEK	85,22	SEK	99,36
Institutional SGD (Hedged): thesaurierend	SGD	5.460	SGD	5.576	SGD	5.453
ausgegebene und umlaufende Anteile		612		635		541
NIW je Anteil	SGD	8,92	SGD	8,78	SGD	10,08
Investor: thesaurierend	$	10		k. A.	$	3.214
ausgegebene und umlaufende Anteile		1		k. A.		321
NIW je Anteil	$	10,11		k. A.	$	10,00
Investor EUR (Hedged): thesaurierend		k. A.		k. A.	€	8
ausgegebene und umlaufende Anteile		k. A.		k. A.		1
NIW je Anteil		k. A.		k. A.	€	9,92
Administrative SEK (Hedged): thesaurierend	SEK	74	SEK	73	SEK	86
ausgegebene und umlaufende Anteile		1		1		1
NIW je Anteil	SEK	85,55	SEK	84,84	SEK	99,39
E Class EUR (Hedged): thesaurierend	€	15.890	€	15.976	€	16.979
ausgegebene und umlaufende Anteile		1.888		1.909		1.718
NIW je Anteil	€	8,42	€	8,37	€	9,88
Z Class: thesaurierend	$	9	$	9	$	10
ausgegebene und umlaufende Anteile		1		1		1
NIW je Anteil	$	9,15	$	8,93	$	10,18
	Commodity Real Return Fund					
Nettovermögen	$	973.166	$	1.369.877	$	1.444.182
Institutional: thesaurierend	$	332.647	$	397.781	$	587.333
ausgegebene und umlaufende Anteile		37.836		41.220		67.481
NIW je Anteil	$	8,79	$	9,65	$	8,70
Institutional EUR (Hedged): thesaurierend	€	129.132	€	225.302	€	144.220
ausgegebene und umlaufende Anteile		15.315		23.996		16.678
NIW je Anteil	€	8,43	€	9,39	€	8,65

	Zum 30. Jun. 2023	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021
	Commodity Real Return Fund (Fortsetzung)		
Institutional EUR (Unhedged):			
thesaurierend	€ 70.554	€ 87.086	€ 48.990
ausgegebene und umlaufende Anteile	5.933	6.527	4.337
NIW je Anteil	€ 11,89	€ 13,34	€ 11,29
Institutional GBP (Hedged):			
thesaurierend	£ 21.791	£ 39.019	£ 36.172
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.827	2.963	3.012
NIW je Anteil	£ 11,93	£ 13,17	£ 12,01
Institutional GBP (Unhedged):			
Erträge	£ 18.858	£ 17.587	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	2.399	1.881	k. A.
NIW je Anteil	£ 7,86	£ 9,35	k. A.
Investor:			
thesaurierend	$ 29.792	$ 50.111	$ 64.377
ausgegebene und umlaufende Anteile	3.936	6.022	8.546
NIW je Anteil	$ 7,57	$ 8,32	$ 7,53
E Class:			
thesaurierend	$ 184.950	$ 260.353	$ 256.747
ausgegebene und umlaufende Anteile	26.419	33.734	36.552
NIW je Anteil	$ 7,00	$ 7,72	$ 7,02
E Class EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 139.271	€ 238.920	€ 234.570
ausgegebene und umlaufende Anteile	21.684	33.254	35.127
NIW je Anteil	€ 6,42	€ 7,18	€ 6,68
E Class SGD (Hedged):			
thesaurierend	SGD 1.240	SGD 2.069	SGD 352
ausgegebene und umlaufende Anteile	122	183	34
NIW je Anteil	SGD 10,19	SGD 11,30	SGD 10,32
H Institutional:			
thesaurierend	$ 3.379	$ 3.614	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	439	427	k. A.
NIW je Anteil	$ 7,70	$ 8,46	k. A.
	PIMCO Credit Opportunities Bond Fund		
Nettovermögen	$ 99.796	$ 97.153	$ 139.704
Institutional:			
thesaurierend	$ 47.267	$ 44.986	$ 47.099
ausgegebene und umlaufende Anteile	3.372	3.318	3.345
NIW je Anteil	$ 14,02	$ 13,56	$ 14,07
Institutional CHF (Hedged):			
thesaurierend	CHF 13.196	CHF 15.367	CHF 22.488
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.272	1.500	2.060
NIW je Anteil	CHF 10,37	CHF 10,24	CHF 10,92
Institutional EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 16.955	€ 15.443	€ 39.139
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.410	1.312	3.136
NIW je Anteil	€ 12,02	€ 11,77	€ 12,48
E Class:			
thesaurierend	$ 8.613	$ 8.985	$ 9.740
ausgegebene und umlaufende Anteile	748	803	831
NIW je Anteil	$ 11,52	$ 11,20	$ 11,73
E Class EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 9.778	€ 9.455	€ 12.026
ausgegebene und umlaufende Anteile	987	971	1.154
NIW je Anteil	€ 9,91	€ 9,74	€ 10,42

	Zum 30. Jun. 2023	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021
	Diversified Income Fund		
Nettovermögen	$ 7.942.717	$ 8.751.796	$ 16.447.733
Institutional:			
thesaurierend	$ 660.058	$ 824.847	$ 1.243.637
ausgegebene und umlaufende Anteile	27.223	35.047	44.236
NIW je Anteil	$ 24,25	$ 23,54	$ 28,11
Erträge	$ 290.580	$ 352.231	$ 692.397
ausgegebene und umlaufende Anteile	22.875	27.897	44.132
NIW je Anteil	$ 12,70	$ 12,63	$ 15,69
Institutional CAD (Hedged):			
thesaurierend	CAD 433.652	CAD 441.412	CAD 571.190
ausgegebene und umlaufende Anteile	43.275	45.218	48.824
NIW je Anteil	CAD 10,02	CAD 9,76	CAD 11,70
Institutional CHF (Hedged):			
thesaurierend	CHF 13.343	CHF 15.646	CHF 20.277
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.099	1.299	1.371
NIW je Anteil	CHF 12,14	CHF 12,04	CHF 14,79
Erträge	CHF 5.675	CHF 8.022	CHF 13.028
ausgegebene und umlaufende Anteile	798	1.111	1.412
NIW je Anteil	CHF 7,11	CHF 7,22	CHF 9,23
Institutional EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 990.830	€ 998.452	€ 1.703.682
ausgegebene und umlaufende Anteile	63.613	65.216	90.940
NIW je Anteil	€ 15,58	€ 15,31	€ 18,73
Erträge	€ 274.970	€ 330.342	€ 852.032
ausgegebene und umlaufende Anteile	35.726	42.647	86.306
NIW je Anteil	€ 7,70	€ 7,75	€ 9,87
Institutional GBP (Hedged):			
thesaurierend	£ 506.486	£ 572.158	£ 1.248.141
ausgegebene und umlaufende Anteile	38.852	44.993	81.268
NIW je Anteil	£ 13,04	£ 12,72	£ 15,36
Erträge	£ 357.074	£ 391.080	£ 601.893
ausgegebene und umlaufende Anteile	61.740	67.375	81.620
NIW je Anteil	£ 5,78	£ 5,80	£ 7,37
Institutional MXN (Hedged):			
thesaurierend	MXN 454.939	MXN 270.310	MXN 299.232
ausgegebene und umlaufende Anteile	4.515	2.863	2.831
NIW je Anteil	MXN 100,76	MXN 94,40	MXN 105,70
Institutional SEK (Hedged):			
thesaurierend	SEK 168.763	SEK 168.340	SEK 205.009
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.041	1.058	1.057
NIW je Anteil	SEK 162,09	SEK 159,10	SEK 193,88
Institutional SGD (Hedged):			
Erträge	SGD 42.224	SGD 43.716	SGD 79.938
ausgegebene und umlaufende Anteile	5.185	5.366	7.873
NIW je Anteil	SGD 8,14	SGD 8,15	SGD 10,15
Investor:			
thesaurierend	$ 41.904	$ 53.597	$ 83.045
ausgegebene und umlaufende Anteile	3.415	4.492	5.806
NIW je Anteil	$ 12,27	$ 11,93	$ 14,30

	Zum 30. Jun. 2023	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021
	Diversified Income Fund (Fortsetzung)		
Erträge	$ 95.900	$ 89.559	$ 69.026
ausgegebene und umlaufende Anteile	11.171	10.495	6.522
NIW je Anteil	$ 8,59	$ 8,53	$ 10,58
Investor EUR (Hedged): thesaurierend	€ 19.159	€ 21.418	€ 34.903
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.301	1.477	1.960
NIW je Anteil	€ 14,73	€ 14,50	€ 17,81
Erträge	€ 9.462	€ 10.066	€ 11.743
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.300	1.375	1.260
NIW je Anteil	€ 7,28	€ 7,32	€ 9,32
Administrative: Erträge	$ 85.505	$ 87.885	$ 143.334
ausgegebene und umlaufende Anteile	9.121	9.431	12.385
NIW je Anteil	$ 9,37	$ 9,32	$ 11,57
Administrative AUD (Hedged): Erträge	k. A.	AUD 2.794	AUD 3.812
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	341	370
NIW je Anteil	k. A.	AUD 8,18	AUD 10,30
Administrative EUR (Hedged): thesaurierend	€ 3.818	€ 4.330	€ 10.014
ausgegebene und umlaufende Anteile	266	306	575
NIW je Anteil	€ 14,37	€ 14,16	€ 17,42
Administrative GBP (Hedged): Erträge	£ 7.732	£ 8.358	£ 12.610
ausgegebene und umlaufende Anteile	898	972	1.168
NIW je Anteil	£ 8,61	£ 8,60	£ 10,80
Administrative JPY (Hedged): thesaurierend	¥ 354.765	¥ 354.957	¥ 47.222
ausgegebene und umlaufende Anteile	438	438	47
NIW je Anteil	¥ 811,00	¥ 811,00	¥ 1.002,00
Administrative SEK (Hedged): thesaurierend	SEK 70	SEK 78	SEK 84
ausgegebene und umlaufende Anteile	1	1	1
NIW je Anteil	SEK 82,08	SEK 80,78	SEK 98,94
Administrative SGD (Hedged): Erträge	SGD 58.934	SGD 55.693	SGD 101.850
ausgegebene und umlaufende Anteile	7.030	6.640	9.757
NIW je Anteil	SGD 8,38	SGD 8,39	SGD 10,44
BM Retail: ausschüttend II	$ 11.256	$ 9	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.236	1	k. A.
NIW je Anteil	$ 9,11	$ 9,17	k. A.
BN Retail: ausschüttend II	$ 10	$ 9	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	1	1	k. A.
NIW je Anteil	$ 9,10	$ 9,17	k. A.
E Class: thesaurierend	$ 600.086	$ 655.637	$ 1.113.069
ausgegebene und umlaufende Anteile	28.862	32.342	45.554
NIW je Anteil	$ 20,79	$ 20,27	$ 24,43
Erträge	$ 317.720	$ 372.507	$ 630.798
ausgegebene und umlaufende Anteile	28.007	33.038	45.041
NIW je Anteil	$ 11,34	$ 11,28	$ 14,01
E Class CHF (Hedged): thesaurierend	CHF 6.066	CHF 7.655	CHF 9.701
ausgegebene und umlaufende Anteile	725	918	939
NIW je Anteil	CHF 8,37	CHF 8,34	CHF 10,33
E Class EUR (Hedged): thesaurierend	€ 983.703	€ 1.292.425	€ 1.880.735
ausgegebene und umlaufende Anteile	72.415	96.369	113.579
NIW je Anteil	€ 13,58	€ 13,41	€ 16,56
Erträge	€ 678.307	€ 781.155	€ 1.366.978
ausgegebene und umlaufende Anteile	77.231	88.377	121.500
NIW je Anteil	€ 8,78	€ 8,84	€ 11,25

	Zum 30. Jun. 2023	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021
	Diversified Income Fund (Fortsetzung)		
E Class SGD (Hedged): Erträge	SGD 19.184	SGD 22.377	SGD 47.272
ausgegebene und umlaufende Anteile	2.364	2.757	4.674
NIW je Anteil	SGD 8,12	SGD 8,12	SGD 10,11
H Institutional: thesaurierend	$ 515.828	$ 385.630	$ 1.501.526
ausgegebene und umlaufende Anteile	28.222	21.717	70.674
NIW je Anteil	$ 18,28	$ 17,76	$ 21,25
Erträge	$ 170	$ 118	$ 26
ausgegebene und umlaufende Anteile	20	14	2
NIW je Anteil	$ 8,66	$ 8,61	$ 10,70
M Retail: Erträge	$ 139.867	$ 150.260	$ 246.412
ausgegebene und umlaufende Anteile	14.412	15.573	20.577
NIW je Anteil	$ 9,70	$ 9,65	$ 11,98
ausschüttend II	$ 174.305	$ 183.635	$ 311.977
ausgegebene und umlaufende Anteile	22.557	23.717	31.930
NIW je Anteil	$ 7,73	$ 7,74	$ 9,77
M Retail AUD (Hedged): Erträge	AUD 47.073	AUD 49.591	AUD 83.307
ausgegebene und umlaufende Anteile	5.309	5.574	7.442
NIW je Anteil	AUD 8,87	AUD 8,90	AUD 11,19
M Retail SGD (Hedged): ausschüttend II	k. A.	k. A.	SGD 13
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	k. A.	1
NIW je Anteil	k. A.	k. A.	SGD 9,82
N Retail: ausschüttend II	$ 9	$ 9	$ 10
ausgegebene und umlaufende Anteile	1	1	1
NIW je Anteil	$ 8,83	$ 8,61	$ 10,38
T Class: thesaurierend	$ 24.245	$ 25.356	$ 40.854
ausgegebene und umlaufende Anteile	2.165	2.318	3.086
NIW je Anteil	$ 11,20	$ 10,94	$ 13,24
Erträge	$ 6.556	$ 6.829	$ 9.630
ausgegebene und umlaufende Anteile	736	771	876
NIW je Anteil	$ 8,91	$ 8,85	$ 11,00
T Class EUR (Hedged): thesaurierend	€ 36.624	€ 36.445	€ 53.705
ausgegebene und umlaufende Anteile	3.861	3.883	4.616
NIW je Anteil	€ 9,49	€ 9,38	€ 11,63
Erträge	€ 19.186	€ 19.507	€ 28.295
ausgegebene und umlaufende Anteile	2.550	2.576	2.937
NIW je Anteil	€ 7,52	€ 7,57	€ 9,63
W Class: thesaurierend	$ 31.798	$ 64.400	$ 120.525
ausgegebene und umlaufende Anteile	3.535	7.380	11.579
NIW je Anteil	$ 9,00	$ 8,73	$ 10,41
Erträge	$ 13.371	$ 45.458	$ 137.527
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.659	5.672	13.806
NIW je Anteil	$ 8,06	$ 8,01	$ 9,96
W Class CAD (Hedged): thesaurierend	k. A.	k. A.	CAD 14
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	k. A.	1
NIW je Anteil	k. A.	k. A.	CAD 10,38
W Class CHF (Hedged): thesaurierend	CHF 3.197	CHF 10.994	CHF 13.719
ausgegebene und umlaufende Anteile	380	1.317	1.339
NIW je Anteil	CHF 8,42	CHF 8,35	CHF 10,24
Erträge	CHF 422	CHF 699	CHF 1.588
ausgegebene und umlaufende Anteile	56	91	162
NIW je Anteil	CHF 7,56	CHF 7,67	CHF 9,80

	Zum 30. Jun. 2023	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021
	Diversified Income Fund (Fortsetzung)		
W Class EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 6.262	€ 11.937	€ 15.286
ausgegebene und umlaufende Anteile	732	1.420	1.488
NIW je Anteil	€ 8,56	€ 8,40	€ 10,27
Erträge	€ 1.414	€ 3.382	€ 6.737
ausgegebene und umlaufende Anteile	184	438	685
NIW je Anteil	€ 7,67	€ 7,72	€ 9,83
W Class GBP (Hedged):			
thesaurierend	£ 570	£ 2.089	£ 2.371
ausgegebene und umlaufende Anteile	65	243	229
NIW je Anteil	£ 8,81	£ 8,59	£ 10,36
Erträge	£ 323	£ 2.895	£ 3.547
ausgegebene und umlaufende Anteile	41	367	358
NIW je Anteil	£ 7,90	£ 7,89	£ 9,92
W Class SGD (Hedged):			
Erträge	SGD 1.533	SGD 3.079	SGD 4.762
ausgegebene und umlaufende Anteile	192	385	477
NIW je Anteil	SGD 8,00	SGD 8,00	SGD 9,97
	Diversified Income Duration Hedged Fund		
Nettovermögen	$ 521.567	$ 564.684	$ 1.305.365
Institutional:			
thesaurierend	$ 20.919	$ 23.243	$ 64.311
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.401	1.617	4.288
NIW je Anteil	$ 14,93	$ 14,38	$ 15,00
Erträge	k. A.	k. A.	$ 3.462
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	k. A.	326
NIW je Anteil	k. A.	k. A.	$ 10,63
Institutional EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 73.149	€ 87.225	€ 165.664
ausgegebene und umlaufende Anteile	5.603	6.863	12.228
NIW je Anteil	€ 13,05	€ 12,71	€ 13,55
ausschüttend II	€ 9.698	€ 9.995	€ 40.816
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.340	1.372	5.012
NIW je Anteil	€ 7,24	€ 7,29	€ 8,14
Institutional GBP (Hedged):			
thesaurierend	£ 184.957	£ 182.935	£ 312.905
ausgegebene und umlaufende Anteile	12.832	13.134	21.396
NIW je Anteil	£ 14,42	£ 13,93	£ 14,62
Erträge	£ 42.282	£ 63.760	£ 176.678
ausgegebene und umlaufende Anteile	5.315	7.894	19.855
NIW je Anteil	£ 7,96	£ 8,08	£ 8,90
Investor:			
thesaurierend	$ 5.129	$ 5.125	$ 11.010
ausgegebene und umlaufende Anteile	413	428	878
NIW je Anteil	$ 12,42	$ 11,98	$ 12,54
E Class:			
thesaurierend	$ 18.726	$ 24.033	$ 46.891
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.547	2.054	3.805
NIW je Anteil	$ 12,10	$ 11,70	$ 12,32
Erträge	$ 31.528	$ 33.306	$ 38.488
ausgegebene und umlaufende Anteile	3.362	3.579	3.808
NIW je Anteil	$ 9,38	$ 9,30	$ 10,11
E Class EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 43.302	€ 54.593	€ 184.920
ausgegebene und umlaufende Anteile	3.642	4.696	14.788
NIW je Anteil	€ 11,89	€ 11,63	€ 12,50
Erträge	€ 17.174	€ 18.931	€ 29.006
ausgegebene und umlaufende Anteile	2.285	2.511	3.466
NIW je Anteil	€ 7,51	€ 7,54	€ 8,37

	Zum 30. Jun. 2023	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021
	Diversified Income ESG Fund		
Nettovermögen	$ 57.989	$ 9.854	
Institutional:			
thesaurierend	$ 9.677	$ 9.367	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	947	947	k. A.
NIW je Anteil	$ 10,22	$ 9,89	k. A.
Institutional EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 44.038	€ 226	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	4.418	23	k. A.
NIW je Anteil	€ 9,97	€ 9,76	k. A.
Institutional GBP (Hedged):			
thesaurierend	£ 194	£ 188	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	19	19	k. A.
NIW je Anteil	£ 10,11	£ 9,83	k. A.
E Class:			
thesaurierend	$ 10	$ 10	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	1	1	k. A.
NIW je Anteil	$ 10,14	$ 9,85	k. A.
E Class EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 9	€ 9	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	1	1	k. A.
NIW je Anteil	€ 9,88	€ 9,73	k. A.
	Dynamic Bond Fund		
Nettovermögen	$ 3.367.293	$ 3.483.601	$ 3.277.997
Institutional:			
thesaurierend	$ 311.552	$ 470.460	$ 626.628
ausgegebene und umlaufende Anteile	22.406	34.671	42.473
NIW je Anteil	$ 13,90	$ 13,57	$ 14,75
Erträge	$ 83.077	$ 81.771	$ 100.397
ausgegebene und umlaufende Anteile	8.135	8.057	8.882
NIW je Anteil	$ 10,21	$ 10,15	$ 11,30
Institutional CAD (Hedged):			
thesaurierend	CAD 11.508	CAD 11.952	CAD 15.351
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.117	1.186	1.398
NIW je Anteil	CAD 10,30	CAD 10,08	CAD 10,98
Institutional CHF (Hedged):			
thesaurierend	CHF 55.726	CHF 70.173	CHF 87.168
ausgegebene und umlaufende Anteile	5.594	7.073	7.873
NIW je Anteil	CHF 9,96	CHF 9,92	CHF 11,07
Institutional EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 104.271	€ 187.622	€ 348.406
ausgegebene und umlaufende Anteile	8.689	15.837	26.481
NIW je Anteil	€ 12,00	€ 11,85	€ 13,16
Erträge	€ 6.326	€ 11.318	€ 12.768
ausgegebene und umlaufende Anteile	721	1.283	1.272
NIW je Anteil	€ 8,78	€ 8,82	€ 10,04
Institutional GBP (Hedged):			
thesaurierend	£ 1.873.362	£ 1.840.373	£ 887.562
ausgegebene und umlaufende Anteile	152.222	152.611	67.216
NIW je Anteil	£ 12,31	£ 12,06	£ 13,20

	Zum 30. Jun. 2023	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021
	Dynamic Bond Fund (Fortsetzung)		
Erträge	£ 90.524	£ 94.155	£ 253.262
ausgegebene und umlaufende Anteile	10.514	10.906	26.086
NIW je Anteil	£ 8,61	£ 8,63	£ 9,71
Institutional NOK (Hedged):			
thesaurierend	NOK 3.375	NOK 4.066	NOK 131.604
ausgegebene und umlaufende Anteile	276	337	9.965
NIW je Anteil	NOK 12,25	NOK 12,07	NOK 13,21
Institutional SEK (Hedged):			
thesaurierend	k. A.	k. A.	SEK 24.943
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	k. A.	237
NIW je Anteil	k. A.	k. A.	SEK 105,17
Investor:			
thesaurierend	$ 42.841	$ 46.677	$ 56.790
ausgegebene und umlaufende Anteile	3.651	4.069	4.537
NIW je Anteil	$ 11,73	$ 11,47	$ 12,52
Erträge	$ 1.442	$ 2.830	$ 3.932
ausgegebene und umlaufende Anteile	158	312	389
NIW je Anteil	$ 9,14	$ 9,08	$ 10,11
Investor EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 2.036	€ 2.013	€ 5.744
ausgegebene und umlaufende Anteile	200	200	512
NIW je Anteil	€ 10,19	€ 10,08	€ 11,23
Administrative:			
thesaurierend	$ 16.282	$ 21.094	$ 29.563
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.253	1.659	2.128
NIW je Anteil	$ 13,00	$ 12,72	$ 13,90
Administrative EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 640	€ 1.170	€ 3.659
ausgegebene und umlaufende Anteile	57	105	295
NIW je Anteil	€ 11,22	€ 11,11	€ 12,40
Administrative SEK (Hedged):			
thesaurierend	SEK 58.609	SEK 61.257	SEK 81.744
ausgegebene und umlaufende Anteile	565	597	718
NIW je Anteil	SEK 103,78	SEK 102,58	SEK 113,88
E Class:			
thesaurierend	$ 69.275	$ 69.989	$ 92.812
ausgegebene und umlaufende Anteile	6.165	6.354	7.680
NIW je Anteil	$ 11,24	$ 11,01	$ 12,08
Erträge	$ 14.849	$ 14.979	$ 19.242
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.590	1.615	1.862
NIW je Anteil	$ 9,34	$ 9,28	$ 10,33
E Class CHF (Hedged):			
thesaurierend	CHF 8.002	CHF 8.868	CHF 10.761
ausgegebene und umlaufende Anteile	903	1.000	1.078
NIW je Anteil	CHF 8,86	CHF 8,86	CHF 9,98
E Class EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 70.270	€ 73.068	€ 138.697
ausgegebene und umlaufende Anteile	6.614	6.936	11.750
NIW je Anteil	€ 10,62	€ 10,54	€ 11,80
E Class GBP (Hedged):			
thesaurierend	£ 2.845	£ 3.354	£ 3.820
ausgegebene und umlaufende Anteile	265	318	328
NIW je Anteil	£ 10,72	£ 10,55	£ 11,65
G Retail EUR (Hedged):			
Erträge	€ 6.677	€ 7.061	€ 8.905
ausgegebene und umlaufende Anteile	840	896	992
NIW je Anteil	€ 7,95	€ 7,88	€ 8,98
H Institutional:			
thesaurierend	$ 7.808	$ 11.541	$ 18.571
ausgegebene und umlaufende Anteile	750	1.135	1.677
NIW je Anteil	$ 10,42	$ 10,17	$ 11,08

	Zum 30. Jun. 2023	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021
	Dynamic Bond Fund (Fortsetzung)		
Erträge	$ 10	$ 10	$ 11
ausgegebene und umlaufende Anteile	1	1	1
NIW je Anteil	$ 9,18	$ 9,12	$ 10,16
R Class:			
thesaurierend	$ 5.881	$ 6.385	$ 7.736
ausgegebene und umlaufende Anteile	519	577	642
NIW je Anteil	$ 11,34	$ 11,07	$ 12,05
Z Class:			
thesaurierend	$ 6.879	$ 6.683	$ 9.940
ausgegebene und umlaufende Anteile	725	725	1.001
NIW je Anteil	$ 9,49	$ 9,22	$ 9,93
Z Class AUD (Hedged):			
Erträge	AUD 20.723	AUD 27.023	AUD 36.313
ausgegebene und umlaufende Anteile	2.256	2.938	3.513
NIW je Anteil	AUD 9,19	AUD 9,20	AUD 10,34
	Dynamic Multi-Asset Fund		
Nettovermögen	€ 4.258.211	€ 5.115.170	€ 7.635.950
Institutional:			
thesaurierend	€ 1.378.749	€ 1.644.656	€ 2.765.020
ausgegebene und umlaufende Anteile	117.482	137.719	198.997
NIW je Anteil	€ 11,74	€ 11,94	€ 13,89
ausschüttend II	€ 150.789	€ 158.729	€ 238.007
ausgegebene und umlaufende Anteile	14.079	14.419	18.212
NIW je Anteil	€ 10,71	€ 11,01	€ 13,07
Institutional CHF (Hedged):			
thesaurierend	CHF 2.653	CHF 3.063	CHF 5.282
ausgegebene und umlaufende Anteile	264	297	438
NIW je Anteil	CHF 10,04	CHF 10,31	CHF 12,06
Institutional GBP (Hedged):			
thesaurierend	£ 491.171	£ 552.226	£ 576.557
ausgegebene und umlaufende Anteile	39.313	43.745	39.733
NIW je Anteil	£ 12,49	£ 12,62	£ 14,51
Erträge	£ 22.493	£ 33.675	£ 17.109
ausgegebene und umlaufende Anteile	2.083	3.025	1.337
NIW je Anteil	£ 10,80	£ 11,13	£ 12,79
Institutional ILS (Hedged):			
thesaurierend	ILS 17.381	ILS 4.206	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.768	423	k. A.
NIW je Anteil	ILS 9,83	ILS 9,93	k. A.
Institutional SGD (Hedged):			
thesaurierend	SGD 108.401	SGD 109.428	SGD 27.017
ausgegebene und umlaufende Anteile	12.511	12.486	2.702
NIW je Anteil	SGD 8,66	SGD 8,76	SGD 10,00
Institutional USD (Hedged):			
thesaurierend	$ 137.175	$ 156.343	$ 281.670
ausgegebene und umlaufende Anteile	10.077	11.438	18.087
NIW je Anteil	$ 13,61	$ 13,67	$ 15,57
ausschüttend II	$ 4.367	$ 4.450	$ 5.074
ausgegebene und umlaufende Anteile	531	531	512
NIW je Anteil	$ 8,22	$ 8,38	$ 9,92

	Zum 30. Jun. 2023	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021
	Dynamic Multi-Asset Fund (Fortsetzung)		
Investor:			
thesaurierend	€ 10.506	€ 10.626	€ 11.030
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.149	1.140	1.013
NIW je Anteil	€ 9,15	€ 9,32	€ 10,89
Investor USD (Hedged):			
thesaurierend	$ 9	$ 9	$ 10
ausgegebene und umlaufende Anteile	1	1	1
NIW je Anteil	$ 8,89	$ 8,94	$ 10,22
BM Retail AUD (Hedged):			
ausschüttend II	AUD 82	AUD 12	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	9	1	k. A.
NIW je Anteil	AUD 8,83	AUD 9,19	k. A.
BM Retail USD (Hedged):			
ausschüttend II	$ 444	$ 9	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	50	1	k. A.
NIW je Anteil	$ 8,97	$ 9,25	k. A.
E Class:			
thesaurierend	€ 1.491.335	€ 1.913.579	€ 2.955.626
ausgegebene und umlaufende Anteile	137.037	171.934	225.981
NIW je Anteil	€ 10,88	€ 11,13	€ 13,08
Erträge	€ 3.967	€ 4.679	€ 5.627
ausgegebene und umlaufende Anteile	440	506	517
NIW je Anteil	€ 9,02	€ 9,25	€ 10,87
E Class USD (Hedged):			
thesaurierend	$ 161.299	$ 192.230	$ 275.658
ausgegebene und umlaufende Anteile	14.104	16.657	20.756
NIW je Anteil	$ 11,44	$ 11,54	$ 13,28
Erträge	$ 32	$ 32	$ 10
ausgegebene und umlaufende Anteile	4	4	1
NIW je Anteil	$ 8,73	$ 8,84	$ 10,18
ausschüttend II	$ 8	$ 9	$ 10
ausgegebene und umlaufende Anteile	1	1	1
NIW je Anteil	$ 8,08	$ 8,27	$ 9,80
H Institutional USD (Hedged):			
thesaurierend	$ 1.990	$ 2.298	$ 8.850
ausgegebene und umlaufende Anteile	209	240	810
NIW je Anteil	$ 9,53	$ 9,58	$ 10,93
M Retail AUD (Hedged):			
ausschüttend II	AUD 448	AUD 321	AUD 563
ausgegebene und umlaufende Anteile	57	39	57
NIW je Anteil	AUD 7,89	AUD 8,17	AUD 9,87
M Retail SGD (Hedged):			
ausschüttend II	SGD 11.098	SGD 12.812	SGD 16.539
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.377	1.538	1.673
NIW je Anteil	SGD 8,06	SGD 8,33	SGD 9,89
M Retail USD (Hedged):			
ausschüttend II	$ 54.997	$ 65.622	$ 120.842
ausgegebene und umlaufende Anteile	6.186	7.183	11.077
NIW je Anteil	$ 8,89	$ 9,14	$ 10,91
T Class:			
thesaurierend	€ 77.169	€ 83.511	€ 118.172
ausgegebene und umlaufende Anteile	7.698	8.130	9.750
NIW je Anteil	€ 10,02	€ 10,27	€ 12,12

	Zum 30. Jun. 2023	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021
	Dynamic Multi-Asset Fund (Fortsetzung)		
T Class USD (Hedged):			
thesaurierend	$ 3.426	$ 3.396	$ 618
ausgegebene und umlaufende Anteile	407	399	63
NIW je Anteil	$ 8,42	$ 8,51	$ 9,83
Z Class:			
thesaurierend	€ 125.444	€ 151.534	€ 192.397
ausgegebene und umlaufende Anteile	11.817	14.087	15.504
NIW je Anteil	€ 10,62	€ 10,76	€ 12,41
	Emerging Local Bond Fund		
Nettovermögen	$ 2.785.443	$ 1.918.352	$ 2.151.129
Institutional:			
thesaurierend	$ 1.606.951	$ 1.294.872	$ 1.416.960
ausgegebene und umlaufende Anteile	116.296	102.499	104.910
NIW je Anteil	$ 13,82	$ 12,63	$ 13,51
Erträge	$ 71.236	$ 67.598	$ 77.715
ausgegebene und umlaufende Anteile	10.948	11.061	11.365
NIW je Anteil	$ 6,51	$ 6,11	$ 6,84
Institutional CHF (Unhedged):			
thesaurierend	k. A.	k. A.	CHF 397
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	k. A.	44
NIW je Anteil	k. A.	k. A.	CHF 9,06
Institutional EUR (Unhedged):			
thesaurierend	€ 394.731	€ 172.081	€ 250.076
ausgegebene und umlaufende Anteile	28.260	13.181	19.088
NIW je Anteil	€ 13,97	€ 13,06	€ 13,10
Erträge	€ 160.526	€ 132.910	€ 123.817
ausgegebene und umlaufende Anteile	23.361	20.143	17.869
NIW je Anteil	€ 6,87	€ 6,60	€ 6,93
Institutional GBP (Unhedged):			
thesaurierend	£ 4.577	£ 3.789	£ 2.364
ausgegebene und umlaufende Anteile	213	183	120
NIW je Anteil	£ 21,47	£ 20,74	£ 19,70
Investor:			
thesaurierend	$ 6.492	$ 19.062	$ 38.617
ausgegebene und umlaufende Anteile	624	2.001	3.779
NIW je Anteil	$ 10,40	$ 9,53	$ 10,22
Investor EUR (Unhedged):			
thesaurierend	€ 745	€ 698	€ 3.081
ausgegebene und umlaufende Anteile	75	75	330
NIW je Anteil	€ 9,90	€ 9,27	€ 9,33
E Class:			
thesaurierend	$ 50.073	$ 35.711	$ 39.398
ausgegebene und umlaufende Anteile	4.185	3.249	3.319
NIW je Anteil	$ 11,96	$ 10,99	$ 11,87
Erträge	$ 13.319	$ 12.976	$ 15.964
ausgegebene und umlaufende Anteile	2.185	2.266	2.492
NIW je Anteil	$ 6,10	$ 5,73	$ 6,41
E Class EUR (Unhedged):			
thesaurierend	€ 80.099	€ 64.970	€ 77.057
ausgegebene und umlaufende Anteile	5.303	4.579	5.359
NIW je Anteil	€ 15,10	€ 14,19	€ 14,38
Erträge	€ 1.516	€ 1.509	€ 1.782
ausgegebene und umlaufende Anteile	162	168	189
NIW je Anteil	€ 9,33	€ 8,96	€ 9,41
H Institutional:			
thesaurierend	$ 307.491	$ 48.177	$ 10
ausgegebene und umlaufende Anteile	31.625	5.416	1
NIW je Anteil	$ 9,72	$ 8,90	$ 9,52

	Zum 30. Jun. 2023	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021
	Emerging Local Bond Fund (Fortsetzung)		
Z Class:			
Erträge	$ 28.420	$ 38.202	$ 40.482
ausgegebene und umlaufende Anteile	3.646	5.218	4.941
NIW je Anteil	$ 7,79	$ 7,32	$ 8,19
	Emerging Local Bond ESG Fund		
Nettovermögen	$ 7.692	$ 6.609	$
Institutional:			
thesaurierend	$ 5.662	$ 5.169	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	489	489	k. A.
NIW je Anteil	$ 11,58	$ 10,57	k. A.
Erträge	$ 12	$ 11	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	1	1	k. A.
NIW je Anteil	$ 11,00	$ 10,34	k. A.
Institutional EUR (Unhedged):			
thesaurierend	€ 409	€ 9	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	38	1	k. A.
NIW je Anteil	€ 10,74	€ 10,02	k. A.
Erträge	€ 10	€ 9	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	1	1	k. A.
NIW je Anteil	€ 10,20	€ 9,81	k. A.
Institutional GBP (Unhedged):			
Erträge	£ 8	k. A.	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	1	k. A.	k. A.
NIW je Anteil	£ 9,93	k. A.	k. A.
Investor:			
thesaurierend	$ 12	$ 11	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	1	1	k. A.
NIW je Anteil	$ 11,54	$ 10,56	k. A.
Erträge	$ 12	$ 11	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	1	1	k. A.
NIW je Anteil	$ 11,00	$ 10,34	k. A.
Investor EUR (Unhedged):			
thesaurierend	€ 10	€ 9	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	1	1	k. A.
NIW je Anteil	€ 10,70	€ 10,01	k. A.
Erträge	€ 10	€ 9	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	1	1	k. A.
NIW je Anteil	€ 10,20	€ 9,81	k. A.
E Class:			
thesaurierend	$ 11	$ 11	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	1	1	k. A.
NIW je Anteil	$ 11,47	$ 10,53	k. A.
Erträge	$ 11	$ 11	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	1	1	k. A.
NIW je Anteil	$ 11,00	$ 10,34	k. A.
E Class EUR (Unhedged):			
thesaurierend	€ 10	€ 9	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	1	1	k. A.
NIW je Anteil	€ 10,64	€ 9,98	k. A.
Erträge	€ 10	€ 9	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	1	1	k. A.
NIW je Anteil	€ 10,20	€ 9,80	k. A.
Z Class:			
thesaurierend	$ 1.462	$ 1.329	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	123	123	k. A.
NIW je Anteil	$ 11,85	$ 10,77	k. A.

	Zum 30. Jun. 2023	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021
	Emerging Markets Bond Fund		
Nettovermögen	$ 3.389.647	$ 3.305.979	$ 4.714.744
Institutional:			
thesaurierend	$ 1.133.970	$ 1.097.175	$ 1.578.727
ausgegebene und umlaufende Anteile	24.102	24.303	28.997
NIW je Anteil	$ 47,05	$ 45,15	$ 54,45
Erträge	$ 57.871	$ 56.849	$ 92.620
ausgegebene und umlaufende Anteile	3.880	3.860	4.961
NIW je Anteil	$ 14,91	$ 14,73	$ 18,67
Institutional CHF (Hedged):			
Erträge	CHF 74.259	CHF 77.505	CHF 97.681
ausgegebene und umlaufende Anteile	5.209	5.390	5.215
NIW je Anteil	CHF 14,26	CHF 14,38	CHF 18,73
Institutional EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 708.917	€ 694.951	€ 695.028
ausgegebene und umlaufende Anteile	19.469	19.643	15.897
NIW je Anteil	€ 36,41	€ 35,38	€ 43,72
Erträge	€ 401.045	€ 401.157	€ 847.991
ausgegebene und umlaufende Anteile	58.809	58.854	95.747
NIW je Anteil	€ 6,82	€ 6,82	€ 8,86
Institutional EUR (Unhedged):			
thesaurierend	€ 180.989	€ 135.251	€ 164.246
ausgegebene und umlaufende Anteile	15.788	12.028	12.905
NIW je Anteil	€ 11,46	€ 11,24	€ 12,73
Institutional GBP (Hedged):			
thesaurierend	£ 20.148	£ 23.424	£ 26.418
ausgegebene und umlaufende Anteile	827	997	922
NIW je Anteil	£ 24,37	£ 23,50	£ 28,67
Erträge	£ 25.312	£ 28.487	£ 41.458
ausgegebene und umlaufende Anteile	7.197	8.167	9.258
NIW je Anteil	£ 3,52	£ 3,49	£ 4,48
Institutional PLN (Hedged):			
Erträge	k. A.	k. A.	PLN 95.531
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	k. A.	9.927
NIW je Anteil	k. A.	k. A.	PLN 9,62
Institutional SGD (Hedged):			
thesaurierend	SGD 25.251	SGD 31.394	SGD 32.296
ausgegebene und umlaufende Anteile	2.468	3.178	2.703
NIW je Anteil	SGD 10,23	SGD 9,88	SGD 11,95
Investor:			
thesaurierend	$ 3.855	$ 3.988	$ 7.210
ausgegebene und umlaufende Anteile	88	95	142
NIW je Anteil	$ 43,70	$ 42,01	$ 50,84
Investor EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 3.337	€ 3.248	€ 4.103
ausgegebene und umlaufende Anteile	398	398	406
NIW je Anteil	€ 8,38	€ 8,16	€ 10,11
Administrative:			
thesaurierend	$ 24.780	$ 22.981	$ 34.503
ausgegebene und umlaufende Anteile	581	560	693
NIW je Anteil	$ 42,69	$ 41,06	$ 49,77

	Zum 30. Jun. 2023	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021
	Emerging Markets Bond Fund (Fortsetzung)		
BM Retail:			
ausschüttend II	$ 354	$ 9	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	39	1	k. A.
NIW je Anteil	$ 9,10	$ 9,11	k. A.
E Class:			
thesaurierend	$ 111.695	$ 114.186	$ 165.453
ausgegebene und umlaufende Anteile	2.765	2.933	3.492
NIW je Anteil	$ 40,39	$ 38,93	$ 47,38
Erträge	$ 53.595	$ 61.547	$ 109.051
ausgegebene und umlaufende Anteile	5.960	6.932	9.691
NIW je Anteil	$ 8,99	$ 8,88	$ 11,25
E Class EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 123.511	€ 125.229	€ 187.716
ausgegebene und umlaufende Anteile	3.958	4.112	4.943
NIW je Anteil	€ 31,21	€ 30,46	€ 37,98
E Class SGD (Hedged):			
thesaurierend	SGD 10.517	SGD 10.020	SGD 11.604
ausgegebene und umlaufende Anteile	185	181	172
NIW je Anteil	SGD 56,96	SGD 55,23	SGD 67,40
H Institutional:			
thesaurierend	$ 264.425	$ 302.479	$ 284.247
ausgegebene und umlaufende Anteile	5.773	6.875	5.348
NIW je Anteil	$ 45,81	$ 44,00	$ 53,15
Erträge	$ 220	$ 217	$ 275
ausgegebene und umlaufende Anteile	29	29	29
NIW je Anteil	$ 7,64	$ 7,55	$ 9,57
M Retail:			
Erträge	$ 8.535	$ 8.675	$ 12.295
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.054	1.085	1.214
NIW je Anteil	$ 8,10	$ 8,00	$ 10,13
ausschüttend II	$ 4.105	$ 3.190	$ 3.720
ausgegebene und umlaufende Anteile	606	473	428
NIW je Anteil	$ 6,78	$ 6,75	$ 8,68
M Retail AUD (Hedged):			
Erträge	AUD 2.087	AUD 1.510	AUD 7.264
ausgegebene und umlaufende Anteile	288	209	784
NIW je Anteil	AUD 7,24	AUD 7,22	AUD 9,27
Z Class:			
Erträge	$ 10.803	$ 5.279	$ 6.317
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.090	540	509
NIW je Anteil	$ 9,91	$ 9,78	$ 12,41
	Emerging Markets Bond ESG Fund		
Nettovermögen	$ 2.372.964	$ 2.492.475	$ 2.635.769
Institutional:			
thesaurierend	$ 663.705	$ 640.128	$ 650.604
ausgegebene und umlaufende Anteile	44.995	45.303	37.005
NIW je Anteil	$ 14,75	$ 14,13	$ 17,58
Erträge	$ 249.514	$ 306.128	$ 305.572
ausgegebene und umlaufende Anteile	32.543	40.679	31.166
NIW je Anteil	$ 7,67	$ 7,53	$ 9,80

	Zum 30. Jun. 2023	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021
	Emerging Markets Bond ESG Fund (Fortsetzung)		
Institutional CHF (Hedged):			
thesaurierend	CHF 57.114	CHF 53.384	CHF 50.716
ausgegebene und umlaufende Anteile	7.146	6.825	5.067
NIW je Anteil	CHF 7,99	CHF 7,82	CHF 10,01
Institutional EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 918.789	€ 1.011.465	€ 999.329
ausgegebene und umlaufende Anteile	91.704	104.063	80.567
NIW je Anteil	€ 10,02	€ 9,72	€ 12,40
Erträge	€ 161.385	€ 132.184	€ 192.797
ausgegebene und umlaufende Anteile	24.171	19.921	21.737
NIW je Anteil	€ 6,68	€ 6,64	€ 8,87
Institutional GBP (Hedged):			
Erträge	£ 111.994	£ 162.630	£ 80.974
ausgegebene und umlaufende Anteile	15.259	22.478	8.479
NIW je Anteil	£ 7,34	£ 7,24	£ 9,55
Institutional GBP (Unhedged):			
Erträge	£ 4.817	£ 3.960	£ 3.657
ausgegebene und umlaufende Anteile	629	499	398
NIW je Anteil	£ 7,66	£ 7,94	£ 9,19
Investor NOK (Hedged):			
thesaurierend	NOK 5.387	NOK 5.222	NOK 6.610
ausgegebene und umlaufende Anteile	50	50	50
NIW je Anteil	NOK 107,24	NOK 103,95	NOK 131,59
Investor SEK (Hedged):			
thesaurierend	SEK 25.694	SEK 27.736	SEK 10.725
ausgegebene und umlaufende Anteile	262	292	89
NIW je Anteil	SEK 97,97	SEK 95,02	SEK 121,06
Administrative:			
thesaurierend	$ 327	$ 314	$ 632
ausgegebene und umlaufende Anteile	37	37	59
NIW je Anteil	$ 8,88	$ 8,53	$ 10,67
Erträge	$ 732	$ 718	$ 992
ausgegebene und umlaufende Anteile	95	95	101
NIW je Anteil	$ 7,67	$ 7,53	$ 9,81
Administrative SEK (Hedged):			
thesaurierend	SEK 203	SEK 105	SEK 85
ausgegebene und umlaufende Anteile	3	1	1
NIW je Anteil	SEK 79,95	SEK 77,61	SEK 99,05
E Class:			
thesaurierend	$ 749	$ 924	$ 1.531
ausgegebene und umlaufende Anteile	93	120	158
NIW je Anteil	$ 8,02	$ 7,71	$ 9,68
Erträge	$ 542	$ 676	$ 868
ausgegebene und umlaufende Anteile	74	94	92
NIW je Anteil	$ 7,36	$ 7,23	$ 9,41
E Class EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 55.074	€ 57.844	€ 129.837
ausgegebene und umlaufende Anteile	6.328	6.822	11.895
NIW je Anteil	€ 8,70	€ 8,48	€ 10,92
Z Class:			
thesaurierend	$ 3.592	k. A.	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	346	k. A.	k. A.
NIW je Anteil	$ 10,39	k. A.	k. A.
	Emerging Markets Corporate Bond Fund		
Nettovermögen	$ 159.733	$ 168.986	$ 212.894
Institutional:			
thesaurierend	$ 10.965	$ 8.279	$ 9.507
ausgegebene und umlaufende Anteile	696	535	532
NIW je Anteil	$ 15,76	$ 15,48	$ 17,88

	Zum 30. Jun. 2023	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021
	Emerging Markets Corporate Bond Fund (Fortsetzung)		
Institutional EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 92.098	€ 102.077	€ 113.058
ausgegebene und umlaufende Anteile	7.070	7.881	7.392
NIW je Anteil	€ 13,03	€ 12,95	€ 15,29
E Class:			
thesaurierend	$ 12.776	$ 15.703	$ 22.756
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.077	1.342	1.668
NIW je Anteil	$ 11,86	$ 11,70	$ 13,64
E Class CHF (Hedged):			
thesaurierend	CHF 9.528	CHF 10.121	CHF 14.255
ausgegebene und umlaufende Anteile	994	1.048	1.235
NIW je Anteil	CHF 9,58	CHF 9,66	CHF 11,54
E Class EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 22.789	€ 23.540	€ 32.022
ausgegebene und umlaufende Anteile	2.004	2.072	2.365
NIW je Anteil	€ 11,38	€ 11,36	€ 13,54
	PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund		
Nettovermögen	$ 230.568	$ 205.131	$ 290.475
Institutional:			
thesaurierend	$ 52.074	$ 25.166	$ 48.615
ausgegebene und umlaufende Anteile	4.804	2.449	4.383
NIW je Anteil	$ 10,84	$ 10,28	$ 11,09
Institutional EUR (Partially Hedged):			
thesaurierend	€ 72.465	€ 72.560	€ 212.680
ausgegebene und umlaufende Anteile	7.159	7.427	19.839
NIW je Anteil	€ 10,12	€ 9,77	€ 10,72
Institutional GBP (Partially Hedged):			
Erträge	£ 783	£ 760	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	83	81	k. A.
NIW je Anteil	£ 9,44	£ 9,37	k. A.
E Class EUR (Partially Hedged):			
thesaurierend	€ 9	€ 9	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	1	1	k. A.
NIW je Anteil	€ 9,68	€ 9,38	k. A.
Z Class:			
thesaurierend	$ 98.430	$ 101.602	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	9.249	10.102	k. A.
NIW je Anteil	$ 10,64	$ 10,06	k. A.
	Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund		
Nettovermögen	$ 20.083	$ 20.937	$ 29.760
Institutional:			
thesaurierend	k. A.	k. A.	$ 114
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	k. A.	8
NIW je Anteil	k. A.	k. A.	$ 14,02
Institutional EUR (Unhedged):			
thesaurierend	€ 6.330	€ 6.154	€ 10.250
ausgegebene und umlaufende Anteile	437	437	743
NIW je Anteil	€ 14,49	€ 14,08	€ 13,80
E Class:			
thesaurierend	$ 4.147	$ 4.388	$ 5.195
ausgegebene und umlaufende Anteile	335	371	417
NIW je Anteil	$ 12,40	$ 11,84	$ 12,47
E Class EUR (Unhedged):			
thesaurierend	€ 8.277	€ 9.351	€ 11.252
ausgegebene und umlaufende Anteile	604	700	852
NIW je Anteil	€ 13,68	€ 13,36	€ 13,20

	Zum 30. Jun. 2023	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021
	PIMCO ESG Income Fund		
Nettovermögen	$ 254.692	$ 237.961	$ 125.087
Institutional:			
thesaurierend	$ 46.808	$ 23.414	$ 5.465
ausgegebene und umlaufende Anteile	4.897	2.486	541
NIW je Anteil	$ 9,56	$ 9,42	$ 10,10
Erträge	$ 78	$ 3.575	$ 3.756
ausgegebene und umlaufende Anteile	9	393	375
NIW je Anteil	$ 9,08	$ 9,10	$ 10,02
Institutional AUD (Hedged):			
Erträge	AUD 67.951	AUD 57.036	AUD 14
ausgegebene und umlaufende Anteile	7.637	6.338	1
NIW je Anteil	AUD 8,90	AUD 9,00	AUD 10,00
Institutional CHF (Hedged):			
thesaurierend	CHF 2.353	CHF 7.316	CHF 692
ausgegebene und umlaufende Anteile	260	803	69
NIW je Anteil	CHF 9,05	CHF 9,11	CHF 10,02
Institutional EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 87.068	€ 105.509	€ 72.025
ausgegebene und umlaufende Anteile	9.472	11.509	7.175
NIW je Anteil	€ 9,19	€ 9,17	€ 10,04
Erträge	€ 2.450	€ 1.925	€ 223
ausgegebene und umlaufende Anteile	281	217	22
NIW je Anteil	€ 8,72	€ 8,85	€ 9,95
Institutional GBP (Hedged):			
Erträge	£ 400	£ 405	£ 482
ausgegebene und umlaufende Anteile	45	44	48
NIW je Anteil	£ 8,94	£ 9,00	£ 9,98
Institutional NOK (Hedged):			
thesaurierend	NOK 93.795	k. A.	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	935	k. A.	k. A.
NIW je Anteil	NOK 100,29	k. A.	k. A.
Institutional SEK (Hedged):			
thesaurierend	SEK 142.648	SEK 122.486	SEK 77.208
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.549	1.335	772
NIW je Anteil	SEK 92,08	SEK 91,73	SEK 99,96
Institutional SGD (Hedged):			
Erträge	SGD 378	SGD 367	SGD 366
ausgegebene und umlaufende Anteile	42	40	36
NIW je Anteil	SGD 9,02	SGD 9,09	SGD 10,02
Administrative SEK (Hedged):			
thesaurierend	SEK 94.159	SEK 79.369	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	967	816	k. A.
NIW je Anteil	SEK 97,34	SEK 97,22	k. A.
E Class:			
thesaurierend	$ 2.136	$ 1.433	$ 285
ausgegebene und umlaufende Anteile	228	155	28
NIW je Anteil	$ 9,38	$ 9,28	$ 10,04
Erträge	$ 478	$ 387	$ 20
ausgegebene und umlaufende Anteile	53	43	2
NIW je Anteil	$ 9,08	$ 9,10	$ 10,01
E Class CHF (Hedged):			
Erträge	CHF 33	CHF 9	CHF 9
ausgegebene und umlaufende Anteile	4	1	1
NIW je Anteil	CHF 8,60	CHF 8,81	CHF 9,94
E Class EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 5.878	€ 4.811	€ 1.113
ausgegebene und umlaufende Anteile	655	535	112
NIW je Anteil	€ 8,98	€ 8,99	€ 9,94
Erträge	€ 1.640	€ 1.016	€ 256
ausgegebene und umlaufende Anteile	188	115	26
NIW je Anteil	€ 8,73	€ 8,86	€ 9,96

	Zum 30. Jun. 2023	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021
	PIMCO ESG Income Fund (Fortsetzung)		
R Class AUD (Hedged):			
Erträge	AUD 29.989	AUD 31.770	AUD 29.726
ausgegebene und umlaufende Anteile	3.370	3.530	2.973
NIW je Anteil	AUD 8,90	AUD 9,00	AUD 10,00
	Euro Bond Fund		
Nettovermögen	€ 1.753.561	€ 1.913.275	€ 2.574.129
Institutional:			
thesaurierend	€ 1.249.288	€ 1.386.127	€ 1.926.406
ausgegebene und umlaufende Anteile	56.667	64.252	73.731
NIW je Anteil	€ 22,05	€ 21,57	€ 26,13
Erträge	€ 40.452	€ 68.589	€ 92.872
ausgegebene und umlaufende Anteile	2.884	4.956	5.474
NIW je Anteil	€ 14,02	€ 13,84	€ 16,97
Institutional CHF (Hedged):			
thesaurierend	CHF 311.440	CHF 313.292	CHF 351.467
ausgegebene und umlaufende Anteile	10.434	10.631	9.789
NIW je Anteil	CHF 29,85	CHF 29,47	CHF 35,91
Investor:			
thesaurierend	€ 17.505	€ 16.885	€ 23.320
ausgegebene und umlaufende Anteile	854	841	956
NIW je Anteil	€ 20,49	€ 20,08	€ 24,41
Erträge	k. A.	k. A.	€ 236
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	k. A.	15
NIW je Anteil	k. A.	k. A.	€ 16,28
Administrative:			
thesaurierend	k. A.	k. A.	€ 2.579
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	k. A.	110
NIW je Anteil	k. A.	k. A.	€ 23,48
E Class:			
thesaurierend	€ 104.052	€ 101.050	€ 151.006
ausgegebene und umlaufende Anteile	5.517	5.451	6.666
NIW je Anteil	€ 18,86	€ 18,54	€ 22,65
Erträge	€ 23.186	€ 23.340	€ 38.508
ausgegebene und umlaufende Anteile	2.291	2.337	3.146
NIW je Anteil	€ 10,12	€ 9,99	€ 12,24
	Euro Credit Fund		
Nettovermögen	€ 609.939	€ 610.008	€ 1.017.163
Institutional:			
thesaurierend	€ 321.840	€ 348.784	€ 743.335
ausgegebene und umlaufende Anteile	21.969	24.516	43.513
NIW je Anteil	€ 14,65	€ 14,23	€ 17,08
ausschüttend II	€ 13.728	€ 16.940	€ 80.562
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.499	1.879	7.303
NIW je Anteil	€ 9,16	€ 9,02	€ 11,03
E Class:			
thesaurierend	€ 39.190	€ 11.194	€ 18.325
ausgegebene und umlaufende Anteile	3.420	1.001	1.353
NIW je Anteil	€ 11,46	€ 11,18	€ 13,54

	Zum 30. Jun. 2023	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021
	Euro Credit Fund (Fortsetzung)		
H Institutional:			
thesaurierend	€ 235.086	€ 232.926	€ 173.091
ausgegebene und umlaufende Anteile	26.606	27.156	16.823
NIW je Anteil	€ 8,84	€ 8,58	€ 10,29
ausschüttend II	€ 95	€ 164	€ 1.850
ausgegebene und umlaufende Anteile	11	20	186
NIW je Anteil	€ 8,28	€ 8,14	€ 9,93
	Euro Income Bond Fund		
Nettovermögen	€ 1.262.170	€ 1.352.980	€ 2.482.304
Institutional:			
thesaurierend	€ 268.786	€ 332.727	€ 895.043
ausgegebene und umlaufende Anteile	18.780	23.944	56.691
NIW je Anteil	€ 14,31	€ 13,90	€ 15,79
Erträge	€ 63.189	€ 79.523	€ 128.548
ausgegebene und umlaufende Anteile	6.688	8.533	11.833
NIW je Anteil	€ 9,45	€ 9,32	€ 10,86
Investor:			
thesaurierend	€ 11.955	€ 10.138	€ 14.129
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.302	1.136	1.388
NIW je Anteil	€ 9,18	€ 8,93	€ 10,18
Erträge	€ 7.961	€ 8.520	€ 10.907
ausgegebene und umlaufende Anteile	867	939	1.027
NIW je Anteil	€ 9,19	€ 9,08	€ 10,62
E Class:			
thesaurierend	€ 532.110	€ 540.713	€ 856.874
ausgegebene und umlaufende Anteile	41.541	43.285	59.839
NIW je Anteil	€ 12,81	€ 12,49	€ 14,32
Erträge	€ 344.813	€ 347.514	€ 527.452
ausgegebene und umlaufende Anteile	41.063	41.763	53.871
NIW je Anteil	€ 8,40	€ 8,32	€ 9,79
Ausschüttend Q	k. A.	k. A.	€ 3.868
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	k. A.	406
NIW je Anteil	k. A.	k. A.	€ 9,53
T Class:			
thesaurierend	€ 24.126	€ 24.746	€ 32.571
ausgegebene und umlaufende Anteile	2.452	2.573	2.943
NIW je Anteil	€ 9,84	€ 9,62	€ 11,07
Erträge	€ 9.230	€ 9.099	€ 12.914
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.242	1.234	1.482
NIW je Anteil	€ 7,43	€ 7,38	€ 8,72
	Euro Long Average Duration Fund		
Nettovermögen	€ 449.965	€ 110.048	€ 160.601
Institutional:			
thesaurierend	€ 449.965	€ 110.048	€ 160.601
ausgegebene und umlaufende Anteile	22.644	5.786	5.426
NIW je Anteil	€ 19,87	€ 19,02	€ 29,60
	Euro Short-Term Fund		
Nettovermögen	€ 213.359	€ 353.095	€ 629.859
Institutional:			
thesaurierend	€ 199.267	€ 339.031	€ 616.693
ausgegebene und umlaufende Anteile	16.588	28.689	51.558
NIW je Anteil	€ 12,01	€ 11,82	€ 11,96
E Class:			
thesaurierend	€ 14.092	€ 14.064	€ 13.166
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.335	1.350	1.239
NIW je Anteil	€ 10,55	€ 10,42	€ 10,63

	Zum 30. Jun. 2023	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021
	PIMCO European High Yield Bond Fund		
Nettovermögen	€ 224.673	€ 174.162	€ 170.489
Institutional:			
thesaurierend	€ 113.197	€ 32.875	€ 12.500
ausgegebene und umlaufende Anteile	11.107	3.379	1.159
NIW je Anteil	€ 10,19	€ 9,73	€ 10,79
E Class:			
thesaurierend	€ 807	€ 10	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	77	1	k. A.
NIW je Anteil	€ 10,42	€ 10,00	k. A.
Erträge	€ 9	k. A.	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	1	k. A.	k. A.
NIW je Anteil	€ 10,04	k. A.	k. A.
Z Class:			
thesaurierend	€ 110.660	€ 141.277	€ 157.989
ausgegebene und umlaufende Anteile	10.663	14.301	14.501
NIW je Anteil	€ 10,38	€ 9,88	€ 10,90
	PIMCO European Short-Term Opportunities Fund		
Nettovermögen	€ 147.878	€ 211.172	€ 395.491
Institutional:			
thesaurierend	€ 79.010	€ 127.942	€ 254.925
ausgegebene und umlaufende Anteile	7.148	11.637	22.466
NIW je Anteil	€ 11,05	€ 10,99	€ 11,35
E Class:			
thesaurierend	€ 9.635	€ 7.775	€ 4.368
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.020	826	447
NIW je Anteil	€ 9,45	€ 9,42	€ 9,77
H Institutional:			
thesaurierend	€ 59.233	€ 75.455	€ 136.198
ausgegebene und umlaufende Anteile	6.179	7.907	13.806
NIW je Anteil	€ 9,59	€ 9,54	€ 9,87
	Global Advantage Fund		
Nettovermögen	$ 411.615	$ 410.459	$ 521.067
Institutional:			
thesaurierend	$ 8.132	$ 7.716	$ 24.968
ausgegebene und umlaufende Anteile	601	582	1.630
NIW je Anteil	$ 13,52	$ 13,28	$ 15,32
Institutional CHF (Partially Hedged):			
Erträge	CHF 108.436	CHF 111.046	CHF 132.681
ausgegebene und umlaufende Anteile	12.443	12.487	12.823
NIW je Anteil	CHF 8,71	CHF 8,89	CHF 10,35
Institutional EUR (Partially Hedged):			
thesaurierend	€ 201.137	€ 203.446	€ 237.602
ausgegebene und umlaufende Anteile	15.529	15.828	16.656
NIW je Anteil	€ 12,95	€ 12,85	€ 14,26
Institutional GBP (Partially Hedged):			
thesaurierend	k. A.	k. A.	£ 182
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	k. A.	14
NIW je Anteil	k. A.	k. A.	£ 13,42
Institutional NOK (Partially Hedged):			
thesaurierend	NOK 600.953	NOK 577.381	NOK 625.501
ausgegebene und umlaufende Anteile	4.103	4.099	4.093
NIW je Anteil	NOK 146,48	NOK 140,84	NOK 152,81
E Class EUR (Partially Hedged):			
thesaurierend	€ 6.182	€ 6.540	€ 8.002
ausgegebene und umlaufende Anteile	543	576	629
NIW je Anteil	€ 11,39	€ 11,36	€ 12,73

	Zum 30. Jun. 2023	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021
	Global Bond Fund		
Nettovermögen	$ 12.611.710	$ 11.420.112	$ 14.038.846
Institutional:			
thesaurierend	$ 3.966.129	$ 3.410.090	$ 3.999.850
ausgegebene und umlaufende Anteile	121.631	107.593	111.904
NIW je Anteil	$ 32,61	$ 31,69	$ 35,74
Erträge	$ 200.181	$ 172.513	$ 203.191
ausgegebene und umlaufende Anteile	11.278	9.898	10.136
NIW je Anteil	$ 17,75	$ 17,43	$ 20,05
Institutional (Currency Exposure):			
thesaurierend	$ 435.322	$ 326.665	$ 328.710
ausgegebene und umlaufende Anteile	14.802	11.261	9.512
NIW je Anteil	$ 29,41	$ 29,01	$ 34,56
Erträge	$ 19.508	$ 19.875	$ 26.341
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.056	1.080	1.178
NIW je Anteil	$ 18,47	$ 18,41	$ 22,37
Institutional CAD (Hedged):			
thesaurierend	CAD 53.605	CAD 54.563	CAD 72.089
ausgegebene und umlaufende Anteile	5.169	5.395	6.309
NIW je Anteil	CAD 10,37	CAD 10,11	CAD 11,43
Institutional CHF (Hedged):			
thesaurierend	CHF 408.918	CHF 440.925	CHF 552.547
ausgegebene und umlaufende Anteile	13.541	14.706	15.928
NIW je Anteil	CHF 30,20	CHF 29,98	CHF 34,69
Erträge	CHF 141.629	CHF 175.781	CHF 218.701
ausgegebene und umlaufende Anteile	8.158	10.095	10.645
NIW je Anteil	CHF 17,36	CHF 17,41	CHF 20,54
Institutional EUR (Currency Exposure):			
thesaurierend	€ 221.278	€ 190.480	€ 139.337
ausgegebene und umlaufende Anteile	17.347	14.810	9.692
NIW je Anteil	€ 12,76	€ 12,86	€ 14,38
Institutional EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 2.003.719	€ 1.974.600	€ 2.453.258
ausgegebene und umlaufende Anteile	78.173	78.287	84.453
NIW je Anteil	€ 25,63	€ 25,22	€ 29,05
Erträge	€ 654.475	€ 512.652	€ 628.774
ausgegebene und umlaufende Anteile	41.060	32.355	33.781
NIW je Anteil	€ 15,94	€ 15,84	€ 18,61
Institutional GBP (Currency Exposure):			
thesaurierend	£ 3.398	£ 3.343	£ 3.600
ausgegebene und umlaufende Anteile	332	313	319
NIW je Anteil	£ 10,24	£ 10,68	£ 11,30
Institutional GBP (Hedged):			
thesaurierend	£ 152.551	£ 162.896	£ 198.000
ausgegebene und umlaufende Anteile	7.207	7.879	8.429
NIW je Anteil	£ 21,17	£ 20,68	£ 23,49
Erträge	£ 124.770	£ 132.242	£ 191.729
ausgegebene und umlaufende Anteile	10.180	10.904	13.574
NIW je Anteil	£ 12,26	£ 12,13	£ 14,13

	Zum 30. Jun. 2023		Zum 31. Dez. 2022		Zum 31. Dez. 2021	
	Global Bond Fund (Fortsetzung)					
Institutional ILS (Hedged):						
thesaurierend		k. A.		k. A.	ILS	304
ausgegebene und umlaufende Anteile		k. A.		k. A.		18
NIW je Anteil		k. A.		k. A.	ILS	16,75
Institutional NOK (Hedged):						
thesaurierend	NOK	2.304.436	NOK	2.918.045	NOK	4.130.842
ausgegebene und umlaufende Anteile		11.023		14.215		17.688
NIW je Anteil	NOK	209,05	NOK	205,28	NOK	233,55
Institutional NZD (Hedged):						
Erträge	NZD	171.963	NZD	167.929	NZD	309.397
ausgegebene und umlaufende Anteile		4.194		4.162		6.643
NIW je Anteil	NZD	41,00	NZD	40,35	NZD	46,57
Institutional SEK (Hedged):						
thesaurierend	SEK	1.153.251	SEK	1.120.588	SEK	1.219.998
ausgegebene und umlaufende Anteile		5.778		5.712		5.426
NIW je Anteil	SEK	199,58	SEK	196,17	SEK	224,86
Institutional SGD (Hedged):						
thesaurierend	SGD	250.973	SGD	217.237	SGD	174.944
ausgegebene und umlaufende Anteile		14.307		12.665		9.030
NIW je Anteil	SGD	17,54	SGD	17,15	SGD	19,37
Erträge	SGD	17		k. A.		k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile		2		k. A.		k. A.
NIW je Anteil	SGD	10,03		k. A.		k. A.
Investor:						
thesaurierend	$	194.564	$	94.643	$	135.136
ausgegebene und umlaufende Anteile		6.492		3.244		4.092
NIW je Anteil	$	29,97	$	29,18	$	33,02
Erträge	$	51.329	$	28.517	$	7.773
ausgegebene und umlaufende Anteile		3.442		1.948		462
NIW je Anteil	$	14,91	$	14,64	$	16,84
Investor (Currency Exposure):						
thesaurierend		k. A.		k. A.	$	2.315
ausgegebene und umlaufende Anteile		k. A.		k. A.		71
NIW je Anteil		k. A.		k. A.	$	32,58
Investor CHF (Hedged):						
thesaurierend	CHF	137.926	CHF	145.814	CHF	188.770
ausgegebene und umlaufende Anteile		11.893		12.641		14.095
NIW je Anteil	CHF	11,60	CHF	11,53	CHF	13,39
Investor EUR (Hedged):						
thesaurierend	€	78.996	€	75.495	€	92.541
ausgegebene und umlaufende Anteile		3.289		3.189		3.382
NIW je Anteil	€	24,02	€	23,68	€	27,36
Investor GBP (Hedged):						
thesaurierend	£	6.531	£	5.437	£	5.846
ausgegebene und umlaufende Anteile		329		280		264
NIW je Anteil	£	19,88	£	19,45	£	22,17
Investor NOK (Hedged):						
thesaurierend	NOK	44.393	NOK	23.662	NOK	28.765
ausgegebene und umlaufende Anteile		225		122		130
NIW je Anteil	NOK	196,93	NOK	193,71	NOK	221,16

	Zum 30. Jun. 2023		Zum 31. Dez. 2022		Zum 31. Dez. 2021	
	Global Bond Fund (Fortsetzung)					
Administrative:						
thesaurierend	$	11.114	$	9.565	$	15.922
ausgegebene und umlaufende Anteile		382		337		495
NIW je Anteil	$	29,12	$	28,38	$	32,16
Administrative SEK (Hedged):						
thesaurierend	SEK	143.527	SEK	114.069	SEK	1.941
ausgegebene und umlaufende Anteile		1.643		1.325		20
NIW je Anteil	SEK	87,36	SEK	86,08	SEK	99,17
E Class:						
thesaurierend	$	364.774	$	326.703	$	463.700
ausgegebene und umlaufende Anteile		13.087		12.006		14.974
NIW je Anteil	$	27,87	$	27,21	$	30,97
Erträge	$	154.008	$	101.393	$	117.421
ausgegebene und umlaufende Anteile		12.012		8.054		8.111
NIW je Anteil	$	12,82	$	12,59	$	14,48
E Class (Currency Exposure):						
thesaurierend	$	41.771	$	34.705	$	61.145
ausgegebene und umlaufende Anteile		3.570		2.994		4.389
NIW je Anteil	$	11,70	$	11,59	$	13,93
Erträge	$	20.543	$	13.040	$	16.440
ausgegebene und umlaufende Anteile		2.078		1.324		1.374
NIW je Anteil	$	9,89	$	9,85	$	11,97
E Class CHF (Hedged):						
thesaurierend	CHF	3.008	CHF	1.921	CHF	2.358
ausgegebene und umlaufende Anteile		336		215		226
NIW je Anteil	CHF	8,94	CHF	8,92	CHF	10,41
E Class EUR (Hedged):						
thesaurierend	€	713.262	€	685.427	€	959.543
ausgegebene und umlaufende Anteile		32.545		31.641		38.117
NIW je Anteil	€	21,92	€	21,66	€	25,17
Erträge	€	38.410	€	31.423	€	41.846
ausgegebene und umlaufende Anteile		4.390		3.613		4.097
NIW je Anteil	€	8,75	€	8,70	€	10,22
E Class NOK (Hedged):						
thesaurierend		k. A.		k. A.	NOK	85
ausgegebene und umlaufende Anteile		k. A.		k. A.		1
NIW je Anteil		k. A.		k. A.	NOK	99,69
G Retail EUR (Hedged):						
Erträge	€	63.243	€	66.161	€	123.034
ausgegebene und umlaufende Anteile		7.127		7.543		11.955
NIW je Anteil	€	8,87	€	8,77	€	10,29
H Institutional:						
thesaurierend	$	881.595	$	752.379	$	835.136
ausgegebene und umlaufende Anteile		27.984		24.551		24.124
NIW je Anteil	$	31,50	$	30,65	$	34,62
Erträge	$	2.143	$	2.035	$	2.643
ausgegebene und umlaufende Anteile		239		231		261
NIW je Anteil	$	8,95	$	8,79	$	10,11
H Institutional (Currency Exposure):						
thesaurierend	$	66.028	$	309.569	$	756
ausgegebene und umlaufende Anteile		7.975		37.885		78
NIW je Anteil	$	8,28	$	8,17	$	9,75
M Retail:						
ausschüttend II	$	1.554	$	1.358	$	1.742
ausgegebene und umlaufende Anteile		173		153		168
NIW je Anteil	$	8,99	$	8,89	$	10,34
M Retail HKD (Unhedged):						
ausschüttend II	HKD	13.199	HKD	5.118	HKD	8.307
ausgegebene und umlaufende Anteile		1.459		575		802
NIW je Anteil	HKD	9,05	HKD	8,91	HKD	10,35
M Retail SEK (Hedged):						
thesaurierend		k. A.		k. A.	SEK	90
ausgegebene und umlaufende Anteile		k. A.		k. A.		1
NIW je Anteil		k. A.		k. A.	SEK	99,56

	Zum 30. Jun. 2023	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021
	Global Bond Fund (Fortsetzung)		
M Retail SGD (Hedged):			
ausschüttend II	SGD 8.238	k. A.	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	825	k. A.	k. A.
NIW je Anteil	SGD 9,98	k. A.	k. A.
R Class EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 6.030	€ 5.591	€ 6.442
ausgegebene und umlaufende Anteile	563	530	528
NIW je Anteil	€ 10,71	€ 10,56	€ 12,19
T Class:			
thesaurierend	$ 16.756	$ 15.814	$ 26.245
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.541	1.487	2.163
NIW je Anteil	$ 10,87	$ 10,63	$ 12,14
Erträge	$ 3.056	$ 3.040	$ 4.183
ausgegebene und umlaufende Anteile	299	303	362
NIW je Anteil	$ 10,22	$ 10,04	$ 11,54
T Class EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 19.604	€ 14.560	€ 19.104
ausgegebene und umlaufende Anteile	2.088	1.567	1.764
NIW je Anteil	€ 9,39	€ 9,29	€ 10,83
W Class:			
thesaurierend	$ 87.738	$ 24.415	$ 29.951
ausgegebene und umlaufende Anteile	9.498	2.721	2.962
NIW je Anteil	$ 9,24	$ 8,97	$ 10,11
Erträge	$ 44.217	$ 9.498	$ 9.066
ausgegebene und umlaufende Anteile	5.057	1.106	919
NIW je Anteil	$ 8,74	$ 8,59	$ 9,87
ausschüttend II	$ 10	k. A.	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	1	k. A.	k. A.
NIW je Anteil	$ 10,06	k. A.	k. A.
W Class (Currency Exposure):			
thesaurierend	k. A.	k. A.	$ 10
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	k. A.	1
NIW je Anteil	k. A.	k. A.	$ 10,00
Erträge	k. A.	k. A.	$ 10
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	k. A.	1
NIW je Anteil	k. A.	k. A.	$ 9,77
W Class CHF (Hedged):			
thesaurierend	CHF 27.948	CHF 24.828	CHF 33.361
ausgegebene und umlaufende Anteile	3.222	2.884	3.352
NIW je Anteil	CHF 8,68	CHF 8,61	CHF 9,95
Erträge	CHF 2.888	CHF 705	CHF 740
ausgegebene und umlaufende Anteile	352	86	76
NIW je Anteil	CHF 8,21	CHF 8,24	CHF 9,72
W Class EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 16.592	€ 9.594	€ 14.976
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.881	1.106	1.500
NIW je Anteil	€ 8,82	€ 8,68	€ 9,98
Erträge	€ 3.775	€ 2.352	€ 2.251
ausgegebene und umlaufende Anteile	452	283	231
NIW je Anteil	€ 8,35	€ 8,30	€ 9,75
W Class GBP (Hedged):			
thesaurierend	£ 10.991	£ 2.383	£ 1.265
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.209	268	126
NIW je Anteil	£ 9,09	£ 8,88	£ 10,08
Erträge	£ 8.358	£ 5.877	£ 9.060
ausgegebene und umlaufende Anteile	971	692	921
NIW je Anteil	£ 8,61	£ 8,49	£ 9,84
W Class NOK (Hedged):			
thesaurierend	NOK 6.347	NOK 4.083	NOK 3.799
ausgegebene und umlaufende Anteile	71	46	38
NIW je Anteil	NOK 90,02	NOK 88,35	NOK 100,41

	Zum 30. Jun. 2023	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021
	Global Bond Fund (Fortsetzung)		
W Class SEK (Hedged):			
thesaurierend	k. A.	k. A.	SEK 89
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	k. A.	1
NIW je Anteil	k. A.	k. A.	SEK 100,33
W Class SGD (Hedged):			
ausschüttend II	SGD 8.489	k. A.	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	847	k. A.	k. A.
NIW je Anteil	SGD 10,02	k. A.	k. A.
	Global Bond ESG Fund		
Nettovermögen	$ 3.344.834	$ 3.106.190	$ 2.302.966
Institutional:			
thesaurierend	$ 306.549	$ 366.227	$ 300.944
ausgegebene und umlaufende Anteile	28.199	34.584	25.077
NIW je Anteil	$ 10,87	$ 10,59	$ 12,00
Erträge	$ 48.694	$ 65.549	$ 25.309
ausgegebene und umlaufende Anteile	5.270	7.213	2.428
NIW je Anteil	$ 9,24	$ 9,09	$ 10,43
Institutional CHF (Hedged):			
thesaurierend	CHF 586.386	CHF 454.679	CHF 22.579
ausgegebene und umlaufende Anteile	63.579	49.550	2.115
NIW je Anteil	CHF 9,22	CHF 9,18	CHF 10,67
Institutional EUR (Currency Exposure):			
thesaurierend	€ 753	€ 3.933	€ 856
ausgegebene und umlaufende Anteile	86	444	86
NIW je Anteil	€ 8,76	€ 8,85	€ 9,96
Institutional EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 866.995	€ 957.548	€ 623.870
ausgegebene und umlaufende Anteile	91.026	101.940	57.390
NIW je Anteil	€ 9,52	€ 9,39	€ 10,87
Erträge	€ 68.746	€ 92.352	€ 111.407
ausgegebene und umlaufende Anteile	7.928	10.695	11.012
NIW je Anteil	€ 8,67	€ 8,63	€ 10,12
Institutional GBP (Currency Exposure):			
Erträge	£ 8	£ 8	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	1	1	k. A.
NIW je Anteil	£ 9,03	£ 9,55	k. A.
Institutional GBP (Hedged):			
thesaurierend	£ 2.345	£ 2.394	£ 16.849
ausgegebene und umlaufende Anteile	254	266	1.634
NIW je Anteil	£ 9,22	£ 9,03	£ 10,31
Erträge	£ 280.534	£ 84.397	£ 75.165
ausgegebene und umlaufende Anteile	30.396	9.242	7.117
NIW je Anteil	£ 9,23	£ 9,13	£ 10,56
Institutional GBP (Unhedged):			
Erträge	£ 23.988	£ 20.996	£ 23.387
ausgegebene und umlaufende Anteile	2.664	2.240	2.448
NIW je Anteil	£ 9,01	£ 9,37	£ 9,55
Institutional NOK (Hedged):			
thesaurierend	NOK 5.924.379	NOK 5.366.868	NOK 5.205.593
ausgegebene und umlaufende Anteile	576.649	531.175	450.696
NIW je Anteil	NOK 10,27	NOK 10,10	NOK 11,55

	Zum 30. Jun. 2023	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021
	Global Bond ESG Fund (Fortsetzung)		
Institutional NZD (Hedged):			
Erträge	NZD 66.272	NZD 64.722	NZD 74.299
ausgegebene und umlaufende Anteile	6.817	6.755	6.732
NIW je Anteil	NZD 9,72	NZD 9,58	NZD 11,04
Institutional SEK (Hedged):			
thesaurierend	SEK 149.958	SEK 504.943	SEK 568.764
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.699	5.807	5.678
NIW je Anteil	SEK 88,28	SEK 86,95	SEK 100,17
Investor:			
thesaurierend	$ 11.112	$ 8.195	$ 12.127
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.073	811	1.055
NIW je Anteil	$ 10,35	$ 10,10	$ 11,49
Administrative:			
thesaurierend	k. A.	k. A.	$ 2.318
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	k. A.	208
NIW je Anteil	k. A.	k. A.	$ 11,12
Erträge	k. A.	k. A.	$ 11
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	k. A.	1
NIW je Anteil	k. A.	k. A.	$ 10,82
Administrative SEK (Hedged):			
thesaurierend	SEK 103	k. A.	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	1	k. A.	k. A.
NIW je Anteil	SEK 99,81	k. A.	k. A.
E Class:			
Erträge	$ 4.262	$ 3.846	$ 2.115
ausgegebene und umlaufende Anteile	445	408	196
NIW je Anteil	$ 9,58	$ 9,42	$ 10,81
E Class CHF (Hedged):			
thesaurierend	CHF 750	CHF 77	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	78	8	k. A.
NIW je Anteil	CHF 9,67	CHF 9,66	k. A.
E Class EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 41.034	€ 38.263	€ 48.847
ausgegebene und umlaufende Anteile	4.556	4.288	4.688
NIW je Anteil	€ 9,01	€ 8,92	€ 10,42
Z Class AUD (Hedged):			
Erträge	AUD 381.343	AUD 356.037	AUD 250.833
ausgegebene und umlaufende Anteile	39.825	37.495	22.777
NIW je Anteil	AUD 9,58	AUD 9,50	AUD 11,01
	Global Bond Ex-US Fund		
Nettovermögen	$ 730.576	$ 716.022	$ 911.707
Institutional:			
thesaurierend	$ 431.110	$ 420.156	$ 527.915
ausgegebene und umlaufende Anteile	18.628	18.790	21.249
NIW je Anteil	$ 23,14	$ 22,36	$ 24,84
Erträge	$ 33.473	$ 32.820	$ 52.506
ausgegebene und umlaufende Anteile	2.200	2.206	3.117
NIW je Anteil	$ 15,21	$ 14,88	$ 16,85
Institutional EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 22.664	€ 45.032	€ 23.841
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.385	2.816	1.315
NIW je Anteil	€ 16,37	€ 15,99	€ 18,13
Investor:			
thesaurierend	$ 6.695	$ 6.657	$ 17.194
ausgegebene und umlaufende Anteile	308	316	732
NIW je Anteil	$ 21,77	$ 21,07	$ 23,49
Administrative:			
thesaurierend	$ 10.266	$ 10.720	$ 12.451
ausgegebene und umlaufende Anteile	487	525	546
NIW je Anteil	$ 21,07	$ 20,41	$ 22,79

	Zum 30. Jun. 2023	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021
	Global Bond Ex-US Fund (Fortsetzung)		
E Class:			
Erträge	$ 48.103	$ 23.336	$ 54.115
ausgegebene und umlaufende Anteile	3.255	1.615	3.309
NIW je Anteil	$ 14,78	$ 14,45	$ 16,36
E Class (Currency Exposure):			
Erträge	$ 57.147	$ 62.837	$ 81.361
ausgegebene und umlaufende Anteile	7.182	7.858	8.142
NIW je Anteil	$ 7,96	$ 8,00	$ 9,99
H Institutional:			
thesaurierend	$ 10.405	$ 6.714	$ 1.160
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.000	667	104
NIW je Anteil	$ 10,40	$ 10,06	$ 11,20
Z Class:			
thesaurierend	$ 108.652	$ 104.722	$ 137.893
ausgegebene und umlaufende Anteile	10.957	10.957	13.049
NIW je Anteil	$ 9,92	$ 9,56	$ 10,57
	PIMCO Global Core Asset Allocation Fund		
Nettovermögen	$ 668.587	$ 750.076	$ 1.035.021
Institutional:			
thesaurierend	$ 29.697	$ 30.140	$ 37.389
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.416	1.526	1.571
NIW je Anteil	$ 20,97	$ 19,74	$ 23,80
Institutional EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 163.646	€ 204.979	€ 352.099
ausgegebene und umlaufende Anteile	8.827	11.632	16.474
NIW je Anteil	€ 18,54	€ 17,62	€ 21,37
Institutional GBP (Hedged):			
Erträge	£ 3.185	£ 3.301	£ 4.301
ausgegebene und umlaufende Anteile	307	331	345
NIW je Anteil	£ 10,38	£ 9,99	£ 12,45
Investor:			
thesaurierend	$ 10.783	$ 10.303	$ 10.116
ausgegebene und umlaufende Anteile	695	704	571
NIW je Anteil	$ 15,52	$ 14,63	$ 17,70
E Class:			
thesaurierend	$ 31.973	$ 32.627	$ 40.303
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.802	1.942	1.966
NIW je Anteil	$ 17,74	$ 16,80	$ 20,50
Erträge	$ 12.324	$ 13.011	$ 13.372
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.325	1.448	1.172
NIW je Anteil	$ 9,30	$ 8,98	$ 11,41
E Class EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 219.668	€ 217.239	€ 230.733
ausgegebene und umlaufende Anteile	14.015	14.494	12.541
NIW je Anteil	€ 15,67	€ 14,99	€ 18,40
Erträge	€ 49.132	€ 49.389	€ 57.708
ausgegebene und umlaufende Anteile	5.891	6.071	5.551
NIW je Anteil	€ 8,34	€ 8,14	€ 10,40
H Institutional:			
thesaurierend	$ 10	$ 9	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	1	1	k. A.
NIW je Anteil	$ 10,01	$ 9,43	k. A.
Erträge	$ 10	$ 9	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	1	1	k. A.
NIW je Anteil	$ 9,55	$ 9,18	k. A.
Z Class:			
thesaurierend	$ 107.942	$ 156.684	$ 199.594
ausgegebene und umlaufende Anteile	6.871	10.644	11.355
NIW je Anteil	$ 15,71	$ 14,72	$ 17,58

	Zum 30. Jun. 2023	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021
	Global High Yield Bond Fund		
Nettovermögen	$ 3.069.836$	3.102.868$	5.169.160
Institutional:			
thesaurierend	$ 603.637$	579.939$	844.967
ausgegebene und umlaufende Anteile	22.235	22.368	29.240
NIW je Anteil	$ 27,15$	25,93$	28,90
Erträge	$ 292.557$	292.202$	489.734
ausgegebene und umlaufende Anteile	29.353	29.927	42.937
NIW je Anteil	$ 9,97$	9,76$	11,41
Institutional CHF (Hedged):			
thesaurierend	CHF 23.368	CHF 22.915	CHF 38.082
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.431	1.439	2.089
NIW je Anteil	CHF 16,33	CHF 15,92	CHF 18,23
Erträge	CHF 2.775	CHF 3.237	CHF 16.630
ausgegebene und umlaufende Anteile	374	436	1.863
NIW je Anteil	CHF 7,42	CHF 7,43	CHF 8,93
Institutional EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 697.933	€ 725.182	€ 1.232.938
ausgegebene und umlaufende Anteile	30.367	32.640	48.671
NIW je Anteil	€ 22,98	€ 22,22	€ 25,33
Erträge	€ 130.874	€ 155.150	€ 119.724
ausgegebene und umlaufende Anteile	13.258	15.853	10.243
NIW je Anteil	€ 9,87	€ 9,79	€ 11,69
Institutional GBP (Hedged):			
thesaurierend	£ 37.494	£ 31.335	£ 239.206
ausgegebene und umlaufende Anteile	2.446	2.130	14.437
NIW je Anteil	£ 15,33	£ 14,71	£ 16,57
Erträge	£ 277.935	£ 292.800	£ 557.487
ausgegebene und umlaufende Anteile	55.590	59.445	95.775
NIW je Anteil	£ 5,00	£ 4,93	£ 5,82
Investor:			
thesaurierend	$ 1.609	$ 1.820	$ 12.295
ausgegebene und umlaufende Anteile	126	149	902
NIW je Anteil	$ 12,74	$ 12,19	$ 13,64
Investor EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 5.598	€ 12.416	€ 5.703
ausgegebene und umlaufende Anteile	255	583	234
NIW je Anteil	€ 21,99	€ 21,30	€ 24,37
Administrative:			
thesaurierend	$ 31.001	$ 30.795	$ 50.855
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.230	1.276	1.881
NIW je Anteil	$ 25,21	$ 24,14	$ 27,04
Erträge	$ 16.535	$ 21.259	$ 32.985
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.695	2.225	2.956
NIW je Anteil	$ 9,76	$ 9,56	$ 11,16
Administrative EUR (Hedged):			
Erträge	k. A.	k. A.	€ 1.908
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	k. A.	196
NIW je Anteil	k. A.	k. A.	€ 9,71
Administrative GBP (Hedged):			
Erträge	k. A.	k. A.	£ 1.111
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	k. A.	106
NIW je Anteil	k. A.	k. A.	£ 10,44

	Zum 30. Jun. 2023	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021
	Global High Yield Bond Fund (Fortsetzung)		
BM Retail:			
ausschüttend II	$ 698	$ 10	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	74	1	k. A.
NIW je Anteil	$ 9,42	$ 9,34	k. A.
E Class:			
thesaurierend	$ 132.190	$ 129.353	$ 186.558
ausgegebene und umlaufende Anteile	5.662	5.776	7.407
NIW je Anteil	$ 23,35	$ 22,40	$ 25,19
Erträge	$ 93.498	$ 109.532	$ 151.015
ausgegebene und umlaufende Anteile	9.523	11.389	13.453
NIW je Anteil	$ 9,82	$ 9,62	$ 11,23
E Class EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 228.096	€ 224.727	€ 299.451
ausgegebene und umlaufende Anteile	10.274	10.424	12.074
NIW je Anteil	€ 22,20	€ 21,56	€ 24,80
Erträge	€ 27.189	€ 27.782	€ 38.159
ausgegebene und umlaufende Anteile	3.369	3.472	3.992
NIW je Anteil	€ 8,07	€ 8,00	€ 9,56
E Class GBP (Hedged):			
Erträge	£ 4.859	£ 5.932	£ 7.285
ausgegebene und umlaufende Anteile	461	572	595
NIW je Anteil	£ 10,55	£ 10,38	£ 12,25
E Class SGD (Hedged):			
Erträge	SGD 7.490	SGD 6.387	SGD 11.731
ausgegebene und umlaufende Anteile	822	711	1.116
NIW je Anteil	SGD 9,11	SGD 8,98	SGD 10,52
H Institutional:			
thesaurierend	$ 192.953	$ 218.500	$ 82.082
ausgegebene und umlaufende Anteile	7.403	8.771	2.952
NIW je Anteil	$ 26,07	$ 24,91	$ 27,81
Erträge	$ 14.121	$ 4.003	$ 10.759
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.598	462	1.064
NIW je Anteil	$ 8,84	$ 8,66	$ 10,11
M Retail:			
Erträge	$ 17.428	$ 17.710	$ 25.552
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.798	1.865	2.306
NIW je Anteil	$ 9,69	$ 9,50	$ 11,08
ausschüttend II	$ 32.785	$ 35.654	$ 107.627
ausgegebene und umlaufende Anteile	4.221	4.652	11.857
NIW je Anteil	$ 7,77	$ 7,66	$ 9,08
R Class:			
thesaurierend	$ 2.607	$ 2.617	$ 73.221
ausgegebene und umlaufende Anteile	175	184	4.598
NIW je Anteil	$ 14,90	$ 14,25	$ 15,92
T Class:			
thesaurierend	$ 5.577	$ 5.339	$ 7.458
ausgegebene und umlaufende Anteile	449	448	554
NIW je Anteil	$ 12,41	$ 11,93	$ 13,47
Erträge	$ 1.833	$ 1.796	$ 2.373
ausgegebene und umlaufende Anteile	200	200	227
NIW je Anteil	$ 9,15	$ 8,96	$ 10,46
T Class EUR (Hedged):			
thesaurierend	k. A.	k. A.	€ 1.450
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	k. A.	130
NIW je Anteil	k. A.	k. A.	€ 11,14

	Zum 30. Jun. 2023	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021
	Global Investment Grade Credit Fund		
Nettovermögen	$ 10.492.851	$ 10.538.341	$ 17.154.925
Institutional:			
thesaurierend	$ 2.487.175	$ 2.618.560	$ 3.806.107
ausgegebene und umlaufende Anteile	129.215	140.682	172.781
NIW je Anteil	$ 19,25	$ 18,61	$ 22,03
Erträge	$ 532.043	$ 474.941	$ 705.907
ausgegebene und umlaufende Anteile	48.764	44.276	53.902
NIW je Anteil	$ 10,91	$ 10,73	$ 13,10
Institutional (Currency Exposure):			
thesaurierend	$ 105.945	$ 100.855	$ 86.823
ausgegebene und umlaufende Anteile	7.520	7.439	5.244
NIW je Anteil	$ 14,09	$ 13,56	$ 16,56
Erträge	$ 21.149	$ 22.435	$ 33.395
ausgegebene und umlaufende Anteile	2.613	2.833	3.347
NIW je Anteil	$ 8,09	$ 7,92	$ 9,98
Institutional AUD (Hedged):			
Erträge	AUD 6.755	AUD 7.370	AUD 90.155
ausgegebene und umlaufende Anteile	783	861	8.528
NIW je Anteil	AUD 8,63	AUD 8,56	AUD 10,57
Institutional CAD (Hedged):			
Erträge	k. A.	k. A.	CAD 12
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	k. A.	1
NIW je Anteil	k. A.	k. A.	CAD 9,70
Institutional CHF (Hedged):			
thesaurierend	CHF 545.661	CHF 656.465	CHF 814.188
ausgegebene und umlaufende Anteile	36.427	44.353	45.260
NIW je Anteil	CHF 14,98	CHF 14,80	CHF 17,99
Erträge	CHF 32.601	CHF 33.474	CHF 49.517
ausgegebene und umlaufende Anteile	4.572	4.674	5.516
NIW je Anteil	CHF 7,13	CHF 7,16	CHF 8,98
Institutional CZK (Hedged):			
Erträge	CZK 246.708	CZK 339.010	CZK 2.085.033
ausgegebene und umlaufende Anteile	29.448	41.499	216.797
NIW je Anteil	CZK 8,38	CZK 8,17	CZK 9,62
Institutional EUR (Currency Exposure):			
thesaurierend	€ 47.121	€ 43.714	€ 39.844
ausgegebene und umlaufende Anteile	3.649	3.441	2.737
NIW je Anteil	€ 12,91	€ 12,70	€ 14,56
Institutional EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 1.105.573	€ 1.343.974	€ 2.237.224
ausgegebene und umlaufende Anteile	64.414	79.965	109.970
NIW je Anteil	€ 17,16	€ 16,81	€ 20,34
Erträge	€ 420.978	€ 447.965	€ 803.485
ausgegebene und umlaufende Anteile	44.462	47.525	68.258
NIW je Anteil	€ 9,47	€ 9,43	€ 11,77
Institutional GBP (Hedged):			
thesaurierend	£ 164.090	£ 112.550	£ 258.867
ausgegebene und umlaufende Anteile	8.522	6.014	11.576
NIW je Anteil	£ 19,26	£ 18,72	£ 22,36

	Zum 30. Jun. 2023	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021
	Global Investment Grade Credit Fund (Fortsetzung)		
Erträge	£ 774.234	£ 767.395	£ 1.684.722
ausgegebene und umlaufende Anteile	69.315	69.403	123.537
NIW je Anteil	£ 11,17	£ 11,06	£ 13,64
Institutional HUF (Hedged):			
Erträge	k. A.	k. A.	HUF 9.873.261
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	k. A.	1.025.701
NIW je Anteil	k. A.	k. A.	HUF 9,63
Institutional ILS (Hedged):			
thesaurierend	k. A.	k. A.	ILS 9.004
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	k. A.	531
NIW je Anteil	k. A.	k. A.	ILS 16,96
Institutional NOK (Hedged):			
thesaurierend	NOK 262.868	NOK 258.128	NOK 429.061
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.921	1.931	2.683
NIW je Anteil	NOK 136,86	NOK 133,69	NOK 159,90
Institutional PLN (Hedged):			
Erträge	k. A.	k. A.	PLN 120.869
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	k. A.	11.435
NIW je Anteil	k. A.	k. A.	PLN 10,57
Institutional SEK (Hedged):			
thesaurierend	SEK 2.720.008	SEK 2.527.557	SEK 3.657.935
ausgegebene und umlaufende Anteile	185.349	176.118	211.649
NIW je Anteil	SEK 14,68	SEK 14,35	SEK 17,28
Institutional SGD (Hedged):			
Erträge	SGD 54.868	SGD 11.301	SGD 8.028
ausgegebene und umlaufende Anteile	6.201	1.291	749
NIW je Anteil	SGD 8,85	SGD 8,76	SGD 10,72
Investor:			
thesaurierend	$ 362.677	$ 440.714	$ 988.957
ausgegebene und umlaufende Anteile	17.322	21.729	41.056
NIW je Anteil	$ 20,94	$ 20,28	$ 24,09
Erträge	$ 143.514	$ 131.169	$ 92.275
ausgegebene und umlaufende Anteile	12.360	11.489	6.624
NIW je Anteil	$ 11,61	$ 11,42	$ 13,93
Investor AUD (Hedged):			
Erträge	AUD 8.279	AUD 10.542	AUD 5.854
ausgegebene und umlaufende Anteile	978	1.256	565
NIW je Anteil	AUD 8,46	AUD 8,39	AUD 10,37
Investor CAD (Hedged):			
Erträge	k. A.	k. A.	CAD 1.822
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	k. A.	175
NIW je Anteil	k. A.	k. A.	CAD 10,44
Investor CHF (Hedged):			
thesaurierend	CHF 4.990	CHF 5.359	CHF 7.624
ausgegebene und umlaufende Anteile	456	494	577
NIW je Anteil	CHF 10,95	CHF 10,84	CHF 13,22
Erträge	CHF 4.101	CHF 5.334	CHF 8.176
ausgegebene und umlaufende Anteile	447	578	707
NIW je Anteil	CHF 9,18	CHF 9,23	CHF 11,56
Investor EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 24.702	€ 26.086	€ 49.619
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.529	1.646	2.577
NIW je Anteil	€ 16,16	€ 15,85	€ 19,25

	Zum 30. Jun. 2023	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021
	Global Investment Grade Credit Fund (Fortsetzung)		
Erträge	€ 10.682	€ 11.379	€ 16.646
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.076	1.151	1.349
NIW je Anteil	€ 9,93	€ 9,88	€ 12,34
Investor GBP (Hedged):			
Erträge	£ 4.161	£ 4.175	£ 5.735
ausgegebene und umlaufende Anteile	383	389	433
NIW je Anteil	£ 10,86	£ 10,73	£ 13,23
Investor RMB (Hedged):			
Erträge	k. A.	k. A.	CNH 3.345
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	k. A.	30
NIW je Anteil	k. A.	k. A.	CNH 111,93
Investor SGD (Hedged):			
Erträge	SGD 8.454	SGD 7.277	SGD 7.473
ausgegebene und umlaufende Anteile	979	852	715
NIW je Anteil	SGD 8,63	SGD 8,54	SGD 10,45
Administrative:			
thesaurierend	$ 78.873	$ 76.931	$ 215.743
ausgegebene und umlaufende Anteile	4.404	4.431	10.444
NIW je Anteil	$ 17,91	$ 17,36	$ 20,66
Erträge	$ 72.099	$ 47.290	$ 99.369
ausgegebene und umlaufende Anteile	6.424	4.285	7.378
NIW je Anteil	$ 11,22	$ 11,04	$ 13,47
Administrative CHF (Hedged):			
thesaurierend	CHF 168	CHF 391	CHF 629
ausgegebene und umlaufende Anteile	17	41	54
NIW je Anteil	CHF 9,63	CHF 9,54	CHF 11,65
Administrative EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 11.659	€ 7.522	€ 9.518
ausgegebene und umlaufende Anteile	765	503	523
NIW je Anteil	€ 15,25	€ 14,97	€ 18,21
Erträge	€ 8.889	€ 7.846	€ 9.315
ausgegebene und umlaufende Anteile	927	822	782
NIW je Anteil	€ 9,59	€ 9,54	€ 11,91
Administrative GBP (Hedged):			
Erträge	£ 6.607	£ 4.557	£ 6.985
ausgegebene und umlaufende Anteile	611	427	531
NIW je Anteil	£ 10,81	£ 10,68	£ 13,17
Administrative HKD (Unhedged):			
Erträge	HKD 34.774	HKD 10.505	HKD 12.810
ausgegebene und umlaufende Anteile	4.033	1.244	1.244
NIW je Anteil	HKD 8,62	HKD 8,44	HKD 10,30
Administrative SEK (Hedged):			
thesaurierend	SEK 309.125	SEK 901.901	SEK 936.226
ausgegebene und umlaufende Anteile	29.862	88.869	76.221
NIW je Anteil	SEK 10,35	SEK 10,15	SEK 12,28
Administrative SGD (Hedged):			
Erträge	SGD 14.957	SGD 2.918	SGD 5.459
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.796	354	542
NIW je Anteil	SGD 8,33	SGD 8,24	SGD 10,08
E Class:			
thesaurierend	$ 715.315	$ 605.749	$ 799.659
ausgegebene und umlaufende Anteile	42.330	36.905	40.796
NIW je Anteil	$ 16,90	$ 16,41	$ 19,60
Erträge	$ 234.329	$ 216.440	$ 341.550
ausgegebene und umlaufende Anteile	19.787	18.589	24.037
NIW je Anteil	$ 11,84	$ 11,64	$ 14,21
E Class CHF (Hedged):			
thesaurierend	CHF 50.739	CHF 52.629	CHF 78.253
ausgegebene und umlaufende Anteile	5.111	5.342	6.476
NIW je Anteil	CHF 9,93	CHF 9,85	CHF 12,08
E Class EUR (Currency Exposure):			
Erträge	€ 1.339	€ 1.340	€ 3.077
ausgegebene und umlaufende Anteile	148	148	288
NIW je Anteil	€ 9,03	€ 9,03	€ 10,67

	Zum 30. Jun. 2023	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021
	Global Investment Grade Credit Fund (Fortsetzung)		
E Class EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 350.509	€ 451.796	€ 630.730
ausgegebene und umlaufende Anteile	23.856	31.264	35.735
NIW je Anteil	€ 14,69	€ 14,45	€ 17,65
Erträge	€ 193.818	€ 197.011	€ 271.438
ausgegebene und umlaufende Anteile	23.730	24.230	26.741
NIW je Anteil	€ 8,17	€ 8,13	€ 10,15
E Class GBP (Hedged):			
Erträge	£ 23.084	£ 20.979	£ 31.335
ausgegebene und umlaufende Anteile	2.045	1.881	2.279
NIW je Anteil	£ 11,29	£ 11,15	£ 13,75
E Class SGD (Hedged):			
Erträge	SGD 39.609	SGD 30.453	SGD 37.343
ausgegebene und umlaufende Anteile	4.467	3.472	3.481
NIW je Anteil	SGD 8,87	SGD 8,77	SGD 10,73
H Institutional:			
thesaurierend	$ 651.396	$ 282.176	$ 168.210
ausgegebene und umlaufende Anteile	32.558	14.572	7.327
NIW je Anteil	$ 20,01	$ 19,36	$ 22,96
Erträge	$ 15.014	$ 17.320	$ 14.287
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.705	2.000	1.351
NIW je Anteil	$ 8,81	$ 8,66	$ 10,57
H Institutional (Currency Exposure):			
thesaurierend	$ 10.495	$ 184.082	$ 10
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.255	22.850	1
NIW je Anteil	$ 8,36	$ 8,06	$ 9,85
M Retail:			
Erträge	$ 27.517	$ 25.037	$ 49.229
ausgegebene und umlaufende Anteile	3.069	2.840	4.577
NIW je Anteil	$ 8,97	$ 8,82	$ 10,76
ausschüttend II	$ 95.460	$ 86.672	$ 120.251
ausgegebene und umlaufende Anteile	11.844	10.861	12.179
NIW je Anteil	$ 8,06	$ 7,98	$ 9,87
M Retail HKD (Unhedged):			
Erträge	HKD 8.840	HKD 8.376	HKD 9.145
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.024	990	887
NIW je Anteil	HKD 8,64	HKD 8,46	HKD 10,31
R Class:			
thesaurierend	$ 12.877	$ 16.316	$ 28.433
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.055	1.381	2.028
NIW je Anteil	$ 12,20	$ 11,81	$ 14,02
Erträge	$ 5.517	$ 4.870	$ 6.925
ausgegebene und umlaufende Anteile	621	558	650
NIW je Anteil	$ 8,88	$ 8,73	$ 10,66
R Class EUR (Hedged):			
Erträge	€ 2.320	€ 2.758	€ 6.026
ausgegebene und umlaufende Anteile	304	364	636
NIW je Anteil	€ 7,62	€ 7,59	€ 9,47
R Class GBP (Hedged):			
Erträge	£ 7.492	£ 8.117	£ 11.449
ausgegebene und umlaufende Anteile	910	998	1.141
NIW je Anteil	£ 8,24	£ 8,14	£ 10,04
T Class:			
thesaurierend	$ 26.667	$ 28.595	$ 42.303
ausgegebene und umlaufende Anteile	2.529	2.786	3.438
NIW je Anteil	$ 10,54	$ 10,26	$ 12,30
T Class EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 4.449	€ 3.508	€ 4.875
ausgegebene und umlaufende Anteile	491	393	446
NIW je Anteil	€ 9,05	€ 8,92	€ 10,94

	Zum 30. Jun. 2023	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021
	Global Investment Grade Credit Fund (Fortsetzung)		
W Class:			
thesaurierend	$ 46.198	$ 32.822	$ 66.615
ausgegebene und umlaufende Anteile	5.185	3.811	6.543
NIW je Anteil	$ 8,91	$ 8,61	$ 10,18
Erträge	$ 16.919	$ 11.533	$ 20.732
ausgegebene und umlaufende Anteile	2.072	1.437	2.116
NIW je Anteil	$ 8,16	$ 8,03	$ 9,80
W Class CHF (Hedged):			
thesaurierend	CHF 20.785	CHF 20.144	CHF 32.864
ausgegebene und umlaufende Anteile	2.486	2.440	3.278
NIW je Anteil	CHF 8,36	CHF 8,26	CHF 10,03
W Class EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 13.389	€ 14.812	€ 150.079
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.576	1.781	14.925
NIW je Anteil	€ 8,49	€ 8,31	€ 10,06
Erträge	€ 4.521	€ 2.194	€ 3.545
ausgegebene und umlaufende Anteile	582	283	367
NIW je Anteil	€ 7,77	€ 7,74	€ 9,67
W Class GBP (Hedged):			
thesaurierend	£ 5.032	£ 3.270	£ 515
ausgegebene und umlaufende Anteile	575	385	51
NIW je Anteil	£ 8,75	£ 8,50	£ 10,15
Erträge	£ 12.924	£ 6.970	£ 16.284
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.613	881	1.668
NIW je Anteil	£ 8,01	£ 7,92	£ 9,76
W Class SGD (Hedged):			
Erträge	SGD 10.224	SGD 4.506	SGD 810
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.263	563	83
NIW je Anteil	SGD 8,09	SGD 8,01	SGD 9,79
	Global Investment Grade Credit ESG Fund		
Nettovermögen	$ 1.819.349	$ 1.369.890	$ 1.189.563
Institutional:			
thesaurierend	$ 64.807	$ 61.632	$ 39.212
ausgegebene und umlaufende Anteile	6.067	5.924	3.211
NIW je Anteil	$ 10,68	$ 10,40	$ 12,21
Erträge	$ 118.837	$ 10.347	$ 19.429
ausgegebene und umlaufende Anteile	13.246	1.167	1.825
NIW je Anteil	$ 8,97	$ 8,86	$ 10,65
Institutional CHF (Hedged):			
thesaurierend	CHF 203.051	CHF 190.278	CHF 185.627
ausgegebene und umlaufende Anteile	21.510	20.258	16.381
NIW je Anteil	CHF 9,44	CHF 9,39	CHF 11,33
Erträge	CHF 2.855	CHF 2.020	CHF 3.002
ausgegebene und umlaufende Anteile	360	253	304
NIW je Anteil	CHF 7,93	CHF 8,00	CHF 9,88
Institutional EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 524.026	€ 220.186	€ 229.148
ausgegebene und umlaufende Anteile	54.149	23.072	19.996
NIW je Anteil	€ 9,68	€ 9,54	€ 11,46

	Zum 30. Jun. 2023	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021
	Global Investment Grade Credit ESG Fund (Fortsetzung)		
Erträge	€ 232.166	€ 320.757	€ 42.749
ausgegebene und umlaufende Anteile	28.732	39.702	4.306
NIW je Anteil	€ 8,08	€ 8,08	€ 9,93
Institutional GBP (Hedged):			
thesaurierend	£ 50.989	£ 72.284	£ 83.370
ausgegebene und umlaufende Anteile	5.028	7.283	7.085
NIW je Anteil	£ 10,14	£ 9,92	£ 11,77
Erträge	£ 103.888	£ 87.512	£ 155.708
ausgegebene und umlaufende Anteile	11.782	9.955	14.592
NIW je Anteil	£ 8,82	£ 8,79	£ 10,67
Institutional SEK (Hedged):			
thesaurierend	SEK 26.192	SEK 11.028	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	249	106	k. A.
NIW je Anteil	SEK 105,23	SEK 103,64	k. A.
Investor EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 10	k. A.	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	1	k. A.	k. A.
NIW je Anteil	€ 10,05	k. A.	k. A.
Erträge	€ 10	k. A.	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	1	k. A.	k. A.
NIW je Anteil	€ 9,92	k. A.	k. A.
Investor:			
thesaurierend	$ 223	$ 217	$ 141
ausgegebene und umlaufende Anteile	25	25	14
NIW je Anteil	$ 8,78	$ 8,56	$ 10,09
Administrative SEK (Hedged):			
thesaurierend	SEK 3.672.748	SEK 3.047.191	SEK 2.293.688
ausgegebene und umlaufende Anteile	41.686	35.030	21.953
NIW je Anteil	SEK 88,10	SEK 86,99	SEK 104,48
E Class:			
thesaurierend	$ 6.254	$ 1.735	$ 3.820
ausgegebene und umlaufende Anteile	705	200	372
NIW je Anteil	$ 8,87	$ 8,68	$ 10,28
Erträge	$ 3.351	$ 446	$ 834
ausgegebene und umlaufende Anteile	392	53	82
NIW je Anteil	$ 8,55	$ 8,45	$ 10,15
E Class CHF (Hedged):			
thesaurierend	CHF 356	CHF 491	CHF 194
ausgegebene und umlaufende Anteile	43	60	19
NIW je Anteil	CHF 8,22	CHF 8,22	CHF 10,01
Erträge	CHF 24	CHF 24	CHF 30
ausgegebene und umlaufende Anteile	3	3	3
NIW je Anteil	CHF 7,93	CHF 8,00	CHF 9,87
E Class EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 23.016	€ 3.370	€ 7.130
ausgegebene und umlaufende Anteile	2.748	406	709
NIW je Anteil	€ 8,38	€ 8,29	€ 10,05
Erträge	€ 568	€ 581	€ 869
ausgegebene und umlaufende Anteile	70	72	88
NIW je Anteil	€ 8,07	€ 8,07	€ 9,92

	Zum 30. Jun. 2023	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021
	Global Investment Grade Credit ESG Fund (Fortsetzung)		
E Class GBP (Hedged):			
thesaurierend	£ 658	£ 420	£ 503
ausgegebene und umlaufende Anteile	76	50	50
NIW je Anteil	£ 8,63	£ 8,49	£ 10,16
Erträge	k. A.	k. A.	£ 104
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	k. A.	10
NIW je Anteil	k. A.	k. A.	£ 10,02
Z Class:			
thesaurierend	$ 4.349	$ 19.339	$ 22.582
ausgegebene und umlaufende Anteile	434	1.986	1.986
NIW je Anteil	$ 10,02	$ 9,74	$ 11,37
	Global Low Duration Real Return Fund		
Nettovermögen	$ 1.253.157	$ 1.364.375	$ 1.199.076
Institutional:			
thesaurierend	$ 73.700	$ 136.292	$ 150.363
ausgegebene und umlaufende Anteile	6.167	11.554	12.580
NIW je Anteil	$ 11,95	$ 11,80	$ 11,95
Institutional CHF (Hedged):			
thesaurierend	CHF 13.325	CHF 22.752	CHF 32.711
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.360	2.303	3.190
NIW je Anteil	CHF 9,80	CHF 9,88	CHF 10,25
Institutional EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 338.233	€ 498.384	€ 518.804
ausgegebene und umlaufende Anteile	32.950	48.614	48.941
NIW je Anteil	€ 10,26	€ 10,25	€ 10,60
Erträge	€ 33.165	€ 34.131	€ 45.289
ausgegebene und umlaufende Anteile	3.810	3.856	4.630
NIW je Anteil	€ 8,70	€ 8,85	€ 9,78
Institutional GBP (Hedged):			
thesaurierend	£ 35.943	£ 55.816	£ 63.979
ausgegebene und umlaufende Anteile	3.274	5.128	5.771
NIW je Anteil	£ 10,98	£ 10,88	£ 11,09
Erträge	£ 64.163	£ 62.640	£ 57.902
ausgegebene und umlaufende Anteile	7.120	6.761	5.720
NIW je Anteil	£ 9,01	£ 9,26	£ 10,12
Institutional SGD (Hedged):			
thesaurierend	SGD 591.060	SGD 351.313	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	58.358	34.943	k. A.
NIW je Anteil	SGD 10,13	SGD 10,05	k. A.
Investor:			
thesaurierend	$ 6.543	$ 6.751	$ 5.146
ausgegebene und umlaufende Anteile	567	591	443
NIW je Anteil	$ 11,55	$ 11,42	$ 11,61
E Class:			
thesaurierend	$ 28.640	$ 34.924	$ 26.574
ausgegebene und umlaufende Anteile	2.608	3.206	2.386
NIW je Anteil	$ 10,98	$ 10,89	$ 11,14
E Class EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 146.816	€ 177.147	€ 153.469
ausgegebene und umlaufende Anteile	15.565	18.721	15.545
NIW je Anteil	€ 9,43	€ 9,46	€ 9,87
	Global Real Return Fund		
Nettovermögen	$ 2.510.669	$ 2.571.862	$ 3.703.379
Institutional:			
thesaurierend	$ 294.010	$ 272.591	$ 380.827
ausgegebene und umlaufende Anteile	13.397	12.628	14.784
NIW je Anteil	$ 21,95	$ 21,59	$ 25,76
Erträge	$ 6.072	$ 12.328	$ 22.531
ausgegebene und umlaufende Anteile	395	796	1.136
NIW je Anteil	$ 15,37	$ 15,49	$ 19,84

	Zum 30. Jun. 2023	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021
	Global Real Return Fund (Fortsetzung)		
Institutional (Currency Exposure):			
thesaurierend	$ 47.610	$ 47.075	$ 68.405
ausgegebene und umlaufende Anteile	4.759	4.828	5.543
NIW je Anteil	$ 10,00	$ 9,75	$ 12,34
Institutional CHF (Hedged):			
thesaurierend	CHF 61.873	CHF 56.131	CHF 63.005
ausgegebene und umlaufende Anteile	4.726	4.267	3.907
NIW je Anteil	CHF 13,09	CHF 13,15	CHF 16,12
Erträge	CHF 27.549	CHF 33.615	CHF 38.988
ausgegebene und umlaufende Anteile	3.293	3.898	3.438
NIW je Anteil	CHF 8,37	CHF 8,62	CHF 11,34
Institutional EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 768.249	€ 824.251	€ 1.075.404
ausgegebene und umlaufende Anteile	42.301	45.572	48.681
NIW je Anteil	€ 18,16	€ 18,09	€ 22,09
Erträge	€ 86.097	€ 98.750	€ 140.728
ausgegebene und umlaufende Anteile	6.903	7.750	8.415
NIW je Anteil	€ 12,47	€ 12,74	€ 16,72
Institutional GBP (Hedged):			
thesaurierend	£ 37.444	£ 38.820	£ 45.209
ausgegebene und umlaufende Anteile	3.144	3.298	3.177
NIW je Anteil	£ 11,91	£ 11,77	£ 14,23
Erträge	£ 217.129	£ 205.454	£ 276.097
ausgegebene und umlaufende Anteile	27.864	25.531	26.297
NIW je Anteil	£ 7,79	£ 8,05	£ 10,50
Institutional SGD (Hedged):			
thesaurierend	SGD 237.375	SGD 236.796	SGD 307.106
ausgegebene und umlaufende Anteile	14.864	14.984	16.250
NIW je Anteil	SGD 15,97	SGD 15,80	SGD 18,90
Investor:			
thesaurierend	$ 41.510	$ 63.935	$ 92.993
ausgegebene und umlaufende Anteile	2.027	3.170	3.850
NIW je Anteil	$ 20,47	$ 20,17	$ 24,16
Erträge	$ 12.164	$ 9.038	$ 31.044
ausgegebene und umlaufende Anteile	909	669	1.795
NIW je Anteil	$ 13,39	$ 13,51	$ 17,30
Investor CHF (Hedged):			
Erträge	CHF 2.223	CHF 2.516	CHF 5.139
ausgegebene und umlaufende Anteile	211	232	360
NIW je Anteil	CHF 10,54	CHF 10,85	CHF 14,28
Investor EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 22.062	€ 22.838	€ 36.406
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.299	1.347	1.752
NIW je Anteil	€ 16,99	€ 16,95	€ 20,77
Administrative:			
thesaurierend	$ 38.210	$ 43.396	$ 71.230
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.910	2.200	3.010
NIW je Anteil	$ 20,01	$ 19,73	$ 23,66
E Class:			
thesaurierend	$ 128.901	$ 153.574	$ 231.761
ausgegebene und umlaufende Anteile	6.876	8.292	10.391
NIW je Anteil	$ 18,75	$ 18,52	$ 22,30
Erträge	$ 31.116	$ 38.490	$ 53.098
ausgegebene und umlaufende Anteile	2.414	2.958	3.187
NIW je Anteil	$ 12,89	$ 13,01	$ 16,66
E Class EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 232.045	€ 234.441	€ 321.175
ausgegebene und umlaufende Anteile	14.941	15.090	16.773
NIW je Anteil	€ 15,53	€ 15,54	€ 19,15
E Class GBP (Hedged):			
Erträge	k. A.	k. A.	£ 4.354
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	k. A.	282
NIW je Anteil	k. A.	k. A.	£ 15,45

	Zum 30. Jun. 2023	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021
	Global Real Return Fund (Fortsetzung)		
H Institutional:			
thesaurierend	$ 89.516	$ 90.138	$ 150.924
ausgegebene und umlaufende Anteile	4.211	4.307	6.032
NIW je Anteil	$ 21,26	$ 20,93	$ 25,02
R Class:			
thesaurierend	$ 1.472	$ 1.569	$ 7.292
ausgegebene und umlaufende Anteile	122	132	514
NIW je Anteil	$ 12,03	$ 11,85	$ 14,18
R Class GBP (Hedged):			
thesaurierend	£ 7.299	£ 8.283	£ 12.683
ausgegebene und umlaufende Anteile	652	747	944
NIW je Anteil	£ 11,20	£ 11,09	£ 13,44
	Income Fund		
Nettovermögen	$ 64.527.567	$ 57.980.327	$ 73.579.726
Institutional:			
thesaurierend	$ 10.183.487	$ 9.197.801	$ 10.989.198
ausgegebene und umlaufende Anteile	624.022	582.256	643.353
NIW je Anteil	$ 16,32	$ 15,80	$ 17,08
Erträge	$ 4.775.220	$ 4.597.148	$ 5.308.194
ausgegebene und umlaufende Anteile	451.613	435.389	442.049
NIW je Anteil	$ 10,57	$ 10,56	$ 12,01
Institutional AUD (Hedged):			
thesaurierend	AUD 90.503	AUD 80.591	AUD 96.588
ausgegebene und umlaufende Anteile	8.351	7.611	8.329
NIW je Anteil	AUD 10,84	AUD 10,59	AUD 11,60
Erträge	k. A.	k. A.	AUD 14
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	k. A.	1
NIW je Anteil	k. A.	k. A.	AUD 9,84
Institutional BRL (Hedged):			
thesaurierend	$ 309.492	$ 274.136	$ 561.362
ausgegebene und umlaufende Anteile	19.367	20.003	43.619
NIW je Anteil	$ 15,98	$ 13,70	$ 12,87
Institutional CAD (Hedged):			
thesaurierend	CAD 78.028	CAD 83.552	CAD 98.436
ausgegebene und umlaufende Anteile	6.190	6.821	7.406
NIW je Anteil	CAD 12,61	CAD 12,25	CAD 13,29
Erträge	CAD 124.176	CAD 117.940	CAD 138.770
ausgegebene und umlaufende Anteile	13.674	12.956	13.346
NIW je Anteil	CAD 9,08	CAD 9,10	CAD 10,40
Institutional CHF (Hedged):			
thesaurierend	CHF 307.727	CHF 293.823	CHF 326.885
ausgegebene und umlaufende Anteile	27.457	26.495	26.540
NIW je Anteil	CHF 11,21	CHF 11,09	CHF 12,32
Erträge	CHF 137.634	CHF 135.996	CHF 178.124
ausgegebene und umlaufende Anteile	17.840	17.253	19.281
NIW je Anteil	CHF 7,71	CHF 7,88	CHF 9,24
Institutional EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 5.193.931	€ 4.856.302	€ 6.397.698
ausgegebene und umlaufende Anteile	374.288	356.885	424.812
NIW je Anteil	€ 13,88	€ 13,61	€ 15,06

	Zum 30. Jun. 2023	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021
	Income Fund (Fortsetzung)		
Erträge	€ 816.287	€ 858.841	€ 1.216.992
ausgegebene und umlaufende Anteile	92.957	96.621	117.285
NIW je Anteil	€ 8,78	€ 8,89	€ 10,38
ausschüttend II	€ 21.441	€ 13.739	€ 21.567
ausgegebene und umlaufende Anteile	2.430	1.555	2.138
NIW je Anteil	€ 8,82	€ 8,84	€ 10,09
Institutional GBP (Hedged):			
thesaurierend	£ 190.987	£ 179.687	£ 223.422
ausgegebene und umlaufende Anteile	17.973	17.378	19.797
NIW je Anteil	£ 10,63	£ 10,34	£ 11,29
Erträge	£ 475.213	£ 437.940	£ 465.680
ausgegebene und umlaufende Anteile	52.738	48.401	44.776
NIW je Anteil	£ 9,01	£ 9,05	£ 10,40
Institutional HKD (Unhedged):			
Erträge	HKD 314.876	HKD 448.226	HKD 798.164
ausgegebene und umlaufende Anteile	32.461	46.468	72.832
NIW je Anteil	HKD 9,70	HKD 9,65	HKD 10,96
Institutional JPY (Hedged):			
thesaurierend	¥ 1.096.657	k. A.	¥ 255.548
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.088	k. A.	229
NIW je Anteil	¥ 1.008,00	k. A.	¥ 1.118,00
Institutional NOK (Hedged):			
thesaurierend	NOK 2.307.266	NOK 2.153.310	NOK 2.187.743
ausgegebene und umlaufende Anteile	20.880	19.915	18.488
NIW je Anteil	NOK 110,50	NOK 108,13	NOK 118,34
Institutional RMB (Hedged):			
thesaurierend	k. A.	k. A.	CNH 66
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	k. A.	1
NIW je Anteil	k. A.	k. A.	CNH 101,42
Institutional SGD (Hedged):			
thesaurierend	SGD 65.749	SGD 57.007	SGD 46.472
ausgegebene und umlaufende Anteile	6.306	5.614	4.222
NIW je Anteil	SGD 10,43	SGD 10,15	SGD 11,01
Erträge	SGD 279.576	SGD 233.054	SGD 277.493
ausgegebene und umlaufende Anteile	29.562	24.522	25.607
NIW je Anteil	SGD 9,46	SGD 9,50	SGD 10,84
Investor:			
thesaurierend	$ 1.886.447	$ 1.938.128	$ 2.841.494
ausgegebene und umlaufende Anteile	142.482	150.961	203.964
NIW je Anteil	$ 13,24	$ 12,84	$ 13,93
Erträge	$ 1.392.843	$ 1.424.611	$ 1.709.869
ausgegebene und umlaufende Anteile	149.643	152.992	160.791
NIW je Anteil	$ 9,31	$ 9,31	$ 10,63
Investor AUD (Hedged):			
Erträge	AUD 75.629	AUD 64.155	AUD 73.714
ausgegebene und umlaufende Anteile	8.817	7.404	7.348
NIW je Anteil	AUD 8,58	AUD 8,66	AUD 10,03
Investor EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 225.120	€ 212.831	€ 508.040
ausgegebene und umlaufende Anteile	20.470	19.702	42.352
NIW je Anteil	€ 11,00	€ 10,80	€ 12,00

	Zum 30. Jun. 2023	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021
	Income Fund (Fortsetzung)		
Erträge	€ 84.129	€ 75.705	€ 105.743
ausgegebene und umlaufende Anteile	11.007	9.766	11.634
NIW je Anteil	€ 7,64	€ 7,75	€ 9,09
ausschüttend A	€ 27.482	€ 29.277	€ 37.920
ausgegebene und umlaufende Anteile	3.386	3.673	4.052
NIW je Anteil	€ 8,12	€ 7,97	€ 9,36
Investor GBP (Hedged): Erträge	£ 18.078	£ 16.799	£ 9.219
ausgegebene und umlaufende Anteile	2.127	1.965	935
NIW je Anteil	£ 8,50	£ 8,55	£ 9,86
Investor JPY (Hedged): thesaurierend	¥ 1.352	k. A.	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	1	k. A.	k. A.
NIW je Anteil	¥ 1.004,00	k. A.	k. A.
Investor RMB (Hedged): thesaurierend	CNH 77.857	CNH 66.886	CNH 124.077
ausgegebene und umlaufende Anteile	663	579	994
NIW je Anteil	CNH 117,35	CNH 115,46	CNH 124,87
Investor SGD (Hedged): thesaurierend	SGD 11.509	SGD 6.150	SGD 1.979
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.142	625	185
NIW je Anteil	SGD 10,08	SGD 9,84	SGD 10,70
Erträge	SGD 49.157	SGD 47.450	SGD 67.208
ausgegebene und umlaufende Anteile	5.570	5.340	6.605
NIW je Anteil	SGD 8,83	SGD 8,89	SGD 10,18
Administrative: thesaurierend	$ 840.852	$ 744.526	$ 912.059
ausgegebene und umlaufende Anteile	71.736	65.457	73.786
NIW je Anteil	$ 11,72	$ 11,37	$ 12,36
Erträge	$ 3.395.699	$ 2.930.269	$ 3.699.459
ausgegebene und umlaufende Anteile	341.794	294.606	325.103
NIW je Anteil	$ 9,93	$ 9,95	$ 11,38
Administrative AUD (Hedged): Erträge	AUD 341.078	AUD 286.887	AUD 316.049
ausgegebene und umlaufende Anteile	38.789	32.273	30.677
NIW je Anteil	AUD 8,79	AUD 8,89	AUD 10,30
Administrative EUR (Hedged): thesaurierend	€ 82.726	€ 96.175	€ 193.792
ausgegebene und umlaufende Anteile	7.577	8.961	16.228
NIW je Anteil	€ 10,92	€ 10,73	€ 11,94
Erträge	€ 287.515	€ 266.419	€ 308.049
ausgegebene und umlaufende Anteile	37.090	33.865	33.362
NIW je Anteil	€ 7,75	€ 7,87	€ 9,23
Administrative GBP (Hedged): Erträge	£ 133.826	£ 112.506	£ 140.149
ausgegebene und umlaufende Anteile	16.298	13.611	14.660
NIW je Anteil	£ 8,21	£ 8,27	£ 9,56
Administrative HKD (Unhedged): Erträge	HKD 4.704.034	HKD 3.221.408	HKD 4.681.912
ausgegebene und umlaufende Anteile	530.871	364.591	463.488
NIW je Anteil	HKD 8,86	HKD 8,84	HKD 10,10

	Zum 30. Jun. 2023	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021
	Income Fund (Fortsetzung)		
Administrative JPY (Hedged): thesaurierend	k. A.	k. A.	¥ 1.099
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	k. A.	1
NIW je Anteil	k. A.	k. A.	¥ 999,00
Administrative SGD (Hedged): Erträge	SGD 1.392.280	SGD 971.804	SGD 1.080.475
ausgegebene und umlaufende Anteile	143.166	99.186	96.129
NIW je Anteil	SGD 9,72	SGD 9,80	SGD 11,24
E Class: thesaurierend	$ 5.276.558	$ 4.837.460	$ 6.088.898
ausgegebene und umlaufende Anteile	355.373	335.073	386.539
NIW je Anteil	$ 14,85	$ 14,44	$ 15,75
Erträge	$ 8.009.068	$ 6.857.888	$ 8.765.914
ausgegebene und umlaufende Anteile	847.381	723.233	804.221
NIW je Anteil	$ 9,45	$ 9,48	$ 10,90
Ausschüttend Q	k. A.	k. A.	$ 2.029
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	k. A.	203
NIW je Anteil	k. A.	k. A.	$ 10,01
E Class AUD (Hedged): Erträge	AUD 718.044	AUD 595.621	AUD 699.187
ausgegebene und umlaufende Anteile	87.174	71.382	71.928
NIW je Anteil	AUD 8,24	AUD 8,34	AUD 9,72
E Class CHF (Hedged): thesaurierend	CHF 77.758	CHF 80.590	CHF 101.113
ausgegebene und umlaufende Anteile	7.257	7.568	8.472
NIW je Anteil	CHF 10,71	CHF 10,65	CHF 11,93
Erträge	CHF 103.829	CHF 80.502	CHF 117.164
ausgegebene und umlaufende Anteile	14.800	11.178	13.731
NIW je Anteil	CHF 7,02	CHF 7,20	CHF 8,53
E Class EUR (Hedged): thesaurierend	€ 4.810.355	€ 4.356.288	€ 5.062.678
ausgegebene und umlaufende Anteile	381.347	350.614	364.865
NIW je Anteil	€ 12,61	€ 12,42	€ 13,88
Erträge	€ 3.520.179	€ 3.436.223	€ 4.359.865
ausgegebene und umlaufende Anteile	448.518	430.505	462.802
NIW je Anteil	€ 7,85	€ 7,98	€ 9,42
ausschüttend II	€ 138.423	€ 121.587	€ 125.779
ausgegebene und umlaufende Anteile	15.696	13.705	12.308
NIW je Anteil	€ 8,82	€ 8,87	€ 10,22
Ausschüttend II Q	€ 35.750	€ 38.028	€ 52.706
ausgegebene und umlaufende Anteile	4.110	4.345	5.208
NIW je Anteil	€ 8,70	€ 8,75	€ 10,12
E Class GBP (Hedged): Erträge	£ 245.413	£ 208.926	£ 236.936
ausgegebene und umlaufende Anteile	31.032	26.188	25.560
NIW je Anteil	£ 7,91	£ 7,98	£ 9,27
E Class HKD (Unhedged): Erträge	HKD 4.185.899	HKD 3.442.414	HKD 4.704.540
ausgegebene und umlaufende Anteile	468.748	385.795	459.225
NIW je Anteil	HKD 8,93	HKD 8,92	HKD 10,24

	Zum 30. Jun. 2023	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021
	Income Fund (Fortsetzung)		
E Class JPY (Hedged):			
thesaurierend	¥ 8.506.391	¥ 4.076.871	¥ 743.601
ausgegebene und umlaufende Anteile	8.857	4.248	692
NIW je Anteil	¥ 960,00	¥ 960,00	¥ 1.075,00
Erträge	¥ 1.633.190	¥ 1.381	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.697	1	k. A.
NIW je Anteil	¥ 962,00	¥ 992,00	k. A.
E Class RMB (Hedged):			
Erträge	CNH 699.958	CNH 490.076	CNH 671.398
ausgegebene und umlaufende Anteile	6.542	4.497	5.397
NIW je Anteil	CNH 107,00	CNH 108,97	CNH 124,39
E Class SGD (Hedged):			
Erträge	SGD 3.648.260	SGD 2.537.340	SGD 2.784.269
ausgegebene und umlaufende Anteile	424.620	292.512	278.445
NIW je Anteil	SGD 8,59	SGD 8,67	SGD 10,00
G Retail EUR (Hedged):			
Erträge	€ 27.873	€ 18.496	€ 29.724
ausgegebene und umlaufende Anteile	3.552	2.393	3.263
NIW je Anteil	€ 7,85	€ 7,73	€ 9,11
G Retail EUR (Unhedged):			
Erträge	k. A.	k. A.	€ 518
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	k. A.	51
NIW je Anteil	k. A.	k. A.	€ 10,11
H Institutional:			
thesaurierend	$ 722.457	$ 669.952	$ 770.236
ausgegebene und umlaufende Anteile	63.301	60.591	64.313
NIW je Anteil	$ 11,41	$ 11,06	$ 11,98
Erträge	$ 345.805	$ 287.285	$ 333.808
ausgegebene und umlaufende Anteile	37.875	31.482	32.084
NIW je Anteil	$ 9,13	$ 9,13	$ 10,40
H Institutional EUR (Hedged):			
thesaurierend	k. A.	k. A.	€ 8.530
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	k. A.	772
NIW je Anteil	k. A.	k. A.	€ 11,05
R Class:			
thesaurierend	$ 89.368	$ 82.073	$ 70.929
ausgegebene und umlaufende Anteile	8.499	8.054	6.420
NIW je Anteil	$ 10,51	$ 10,19	$ 11,05
Erträge	$ 58.929	$ 61.635	$ 84.900
ausgegebene und umlaufende Anteile	6.400	6.695	8.082
NIW je Anteil	$ 9,21	$ 9,21	$ 10,50
R Class EUR (Hedged):			
Erträge	€ 12.270	€ 12.865	€ 16.112
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.515	1.567	1.678
NIW je Anteil	€ 8,10	€ 8,21	€ 9,60
R Class GBP (Hedged):			
Erträge	£ 25.325	£ 20.954	£ 33.995
ausgegebene und umlaufende Anteile	2.697	2.220	3.123
NIW je Anteil	£ 9,39	£ 9,44	£ 10,88

	Zum 30. Jun. 2023	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021
	Income Fund (Fortsetzung)		
T Class:			
thesaurierend	$ 296.211	$ 295.923	$ 371.744
ausgegebene und umlaufende Anteile	24.351	24.971	28.634
NIW je Anteil	$ 12,16	$ 11,85	$ 12,98
Erträge	$ 109.271	$ 102.600	$ 130.671
ausgegebene und umlaufende Anteile	13.148	12.279	13.542
NIW je Anteil	$ 8,31	$ 8,36	$ 9,65
T Class EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 241.934	€ 226.266	€ 268.086
ausgegebene und umlaufende Anteile	23.272	22.053	23.304
NIW je Anteil	€ 10,40	€ 10,26	€ 11,50
Erträge	€ 171.662	€ 165.117	€ 217.088
ausgegebene und umlaufende Anteile	24.740	23.351	25.890
NIW je Anteil	€ 6,94	€ 7,07	€ 8,38
Z Class:			
thesaurierend	$ 189.355	$ 219.519	$ 162.794
ausgegebene und umlaufende Anteile	10.960	13.161	9.076
NIW je Anteil	$ 17,28	$ 16,68	$ 17,94
Z Class AUD (Hedged):			
ausschüttend II	AUD 1.304.615	AUD 1.339.063	AUD 1.451.394
ausgegebene und umlaufende Anteile	133.612	136.394	129.096
NIW je Anteil	AUD 9,76	AUD 9,82	AUD 11,24
	Income Fund II		
Nettovermögen	$ 97.717	$ 56.653	$ 27.770
Institutional:			
thesaurierend	$ 23.146	$ 22.431	$ 24.374
ausgegebene und umlaufende Anteile	2.397	2.396	2.396
NIW je Anteil	$ 9,66	$ 9,36	$ 10,17
Erträge	$ 10	k. A.	$ 10
ausgegebene und umlaufende Anteile	1	k. A.	1
NIW je Anteil	$ 10,07	k. A.	$ 9,94
E Class:			
Erträge	$ 25.759	$ 17.904	$ 1.730
ausgegebene und umlaufende Anteile	2.975	2.069	174
NIW je Anteil	$ 8,66	$ 8,65	$ 9,92
E Class AUD (Hedged):			
Erträge	AUD 9.747	AUD 2.121	AUD 365
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.153	249	37
NIW je Anteil	AUD 8,46	AUD 8,53	AUD 9,90
E Class EUR (Hedged):			
Erträge	€ 4.874	€ 3.223	€ 494
ausgegebene und umlaufende Anteile	589	385	50
NIW je Anteil	€ 8,27	€ 8,38	€ 9,85
E Class GBP (Hedged):			
Erträge	£ 10.435	£ 2.811	£ 196
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.225	329	20
NIW je Anteil	£ 8,52	£ 8,55	£ 9,90
E Class HKD (Unhedged):			
Erträge	HKD 185.961	HKD 62.900	HKD 2.462
ausgegebene und umlaufende Anteile	21.259	7.226	247
NIW je Anteil	HKD 8,75	HKD 8,70	HKD 9,98

	Zum 30. Jun. 2023	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021
	Income Fund II (Fortsetzung)		
E Class SGD (Hedged):			
Erträge	k. A.	k. A.	SGD 333
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	k. A.	34
NIW je Anteil	k. A.	k. A.	SGD 9,93
	Inflation Multi-Asset Fund		
Nettovermögen	$ 324.178	$ 403.078	$ 164.345
Institutional:			
thesaurierend	$ 83.897	$ 83.455	$ 68.012
ausgegebene und umlaufende Anteile	7.498	7.503	5.798
NIW je Anteil	$ 11,19	$ 11,12	$ 11,73
Institutional EUR (Partially Hedged):			
thesaurierend	€ 58.229	€ 82.243	€ 4.749
ausgegebene und umlaufende Anteile	6.229	8.718	477
NIW je Anteil	€ 9,35	€ 9,43	€ 9,96
Institutional GBP (Partially Hedged):			
thesaurierend	£ 3.788	£ 3.543	£ 22.843
ausgegebene und umlaufende Anteile	333	308	1.924
NIW je Anteil	£ 11,37	£ 11,50	£ 11,87
Administrative:			
ausschüttend II	$ 2.460	$ 2.961	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	287	338	k. A.
NIW je Anteil	$ 8,58	$ 8,75	k. A.
Administrative SGD (Hedged):			
ausschüttend II	SGD 6.518	SGD 10.723	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	743	1.197	k. A.
NIW je Anteil	SGD 8,77	SGD 8,95	k. A.
E Class:			
thesaurierend	$ 65.566	$ 85.842	$ 14.809
ausgegebene und umlaufende Anteile	6.615	8.673	1.405
NIW je Anteil	$ 9,91	$ 9,90	$ 10,54
ausschüttend II	$ 9	$ 9	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	1	1	k. A.
NIW je Anteil	$ 9,08	$ 9,27	k. A.
E Class AUD (Partially Hedged):			
thesaurierend	AUD 333	AUD 334	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	36	36	k. A.
NIW je Anteil	AUD 9,34	AUD 9,35	k. A.
E Class EUR (Partially Hedged):			
thesaurierend	€ 81.118	€ 110.990	€ 33.996
ausgegebene und umlaufende Anteile	8.865	11.966	3.436
NIW je Anteil	€ 9,15	€ 9,28	€ 9,89
Erträge	€ 9.280	€ 11.302	€ 5.738
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.108	1.312	608
NIW je Anteil	€ 8,38	€ 8,61	€ 9,43
E Class GBP (Partially Hedged):			
thesaurierend	£ 8	£ 8	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	1	1	k. A.
NIW je Anteil	£ 9,26	£ 9,41	k. A.
E Class SGD (Partially Hedged):			
thesaurierend	SGD 13	SGD 13	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	1	1	k. A.
NIW je Anteil	SGD 9,34	SGD 9,35	k. A.
H Institutional:			
thesaurierend	$ 9	$ 9	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	1	1	k. A.
NIW je Anteil	$ 9,50	$ 9,45	k. A.
M Retail:			
ausschüttend II	$ 209	$ 9	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	23	1	k. A.
NIW je Anteil	$ 9,16	$ 9,32	k. A.

	Zum 30. Jun. 2023	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021
	Low Average Duration Fund		
Nettovermögen	$ 886.012	$ 1.072.758	$ 1.179.138
Institutional:			
thesaurierend	$ 552.752	$ 640.710	$ 747.732
ausgegebene und umlaufende Anteile	35.140	41.077	45.606
NIW je Anteil	$ 15,73	$ 15,60	$ 16,40
Erträge	$ 34.066	$ 53.185	$ 33.312
ausgegebene und umlaufende Anteile	3.471	5.377	3.159
NIW je Anteil	$ 9,81	$ 9,89	$ 10,54
Institutional EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 23.466	€ 37.536	€ 35.456
ausgegebene und umlaufende Anteile	2.423	3.864	3.402
NIW je Anteil	€ 9,68	€ 9,71	€ 10,42
Erträge	€ 3.309	€ 8.986	€ 10.023
ausgegebene und umlaufende Anteile	477	1.270	1.302
NIW je Anteil	€ 6,94	€ 7,08	€ 7,70
Institutional GBP (Hedged):			
thesaurierend	£ 18.782	£ 17.044	£ 13.877
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.919	1.748	1.347
NIW je Anteil	£ 9,79	£ 9,75	£ 10,30
Erträge	£ 3.056	£ 3.285	£ 4.225
ausgegebene und umlaufende Anteile	347	367	439
NIW je Anteil	£ 8,81	£ 8,95	£ 9,64
Investor:			
thesaurierend	$ 14.605	$ 16.532	$ 20.960
ausgegebene und umlaufende Anteile	992	1.131	1.359
NIW je Anteil	$ 14,72	$ 14,62	$ 15,42
Erträge	$ 1.858	$ 2.022	$ 7.973
ausgegebene und umlaufende Anteile	191	206	762
NIW je Anteil	$ 9,74	$ 9,81	$ 10,46
Administrative:			
thesaurierend	$ 9.370	$ 10.755	$ 11.016
ausgegebene und umlaufende Anteile	654	755	733
NIW je Anteil	$ 14,32	$ 14,24	$ 15,04
E Class:			
thesaurierend	$ 44.437	$ 47.980	$ 52.498
ausgegebene und umlaufende Anteile	3.670	3.979	4.104
NIW je Anteil	$ 12,11	$ 12,06	$ 12,79
Erträge	$ 3.957	$ 5.384	$ 6.751
ausgegebene und umlaufende Anteile	391	528	621
NIW je Anteil	$ 10,12	$ 10,20	$ 10,87
E Class EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 23.098	€ 25.480	€ 18.812
ausgegebene und umlaufende Anteile	2.959	3.238	2.209
NIW je Anteil	€ 7,81	€ 7,87	€ 8,52
H Institutional:			
thesaurierend	$ 134.383	$ 186.190	$ 186.367
ausgegebene und umlaufende Anteile	11.384	15.891	15.108
NIW je Anteil	$ 11,81	$ 11,72	$ 12,34
Erträge	$ 1.427	$ 1.521	$ 7.574
ausgegebene und umlaufende Anteile	151	159	745
NIW je Anteil	$ 9,46	$ 9,54	$ 10,16
R Class:			
thesaurierend	$ 6.982	$ 7.183	$ 7.325
ausgegebene und umlaufende Anteile	663	687	665
NIW je Anteil	$ 10,52	$ 10,45	$ 11,02
	Low Duration Global Investment Grade Credit Fund		
Nettovermögen	$ 798.217	$ 654.749	$ 806.869
Institutional:			
thesaurierend	$ 237.291	$ 120.881	$ 94.445
ausgegebene und umlaufende Anteile	20.324	10.562	7.805
NIW je Anteil	$ 11,68	$ 11,44	$ 12,10

	Zum 30. Jun. 2023	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021
	Low Duration Global Investment Grade Credit Fund (Fortsetzung)		
Erträge	$ 16.574	$ 17.001	$ 10
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.795	1.859	1
NIW je Anteil	$ 9,23	$ 9,15	$ 9,82
Institutional EUR (Hedged): thesaurierend	€ 422.000	€ 417.993	€ 520.319
ausgegebene und umlaufende Anteile	41.989	41.937	48.370
NIW je Anteil	€ 10,05	€ 9,97	€ 10,76
Erträge	€ 120	€ 133	€ 928
ausgegebene und umlaufende Anteile	14	15	95
NIW je Anteil	€ 8,88	€ 8,90	€ 9,75
Institutional GBP (Hedged): thesaurierend	£ 19.517	£ 18.388	£ 18.462
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.784	1.708	1.611
NIW je Anteil	£ 10,94	£ 10,77	£ 11,46
Erträge	£ 3.857	£ 3.910	£ 18.096
ausgegebene und umlaufende Anteile	426	432	1.849
NIW je Anteil	£ 9,06	£ 9,06	£ 9,79
Institutional NOK (Hedged): thesaurierend	NOK 166.958	NOK 159.169	NOK 441.039
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.642	1.581	4.119
NIW je Anteil	NOK 101,70	NOK 100,63	NOK 107,06
E Class EUR (Hedged): thesaurierend	€ 35.305	€ 25.901	€ 17.694
ausgegebene und umlaufende Anteile	3.824	2.816	1.767
NIW je Anteil	€ 9,23	€ 9,20	€ 10,01
	Low Duration Income Fund		
Nettovermögen	$ 1.455.385	$ 1.084.380	$ 1.367.475
Institutional: thesaurierend	$ 176.283	$ 186.357	$ 275.963
ausgegebene und umlaufende Anteile	15.608	17.111	24.381
NIW je Anteil	$ 11,29	$ 10,89	$ 11,32
Erträge	$ 5.902	$ 11.734	$ 13.398
ausgegebene und umlaufende Anteile	610	1.229	1.305
NIW je Anteil	$ 9,67	$ 9,56	$ 10,27
Institutional CHF (Hedged): thesaurierend	k. A.	k. A.	CHF 1.854
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	k. A.	178
NIW je Anteil	k. A.	k. A.	CHF 10,43
Institutional EUR (Hedged): thesaurierend	€ 641.714	€ 633.070	€ 666.067
ausgegebene und umlaufende Anteile	63.064	63.769	63.153
NIW je Anteil	€ 10,18	€ 9,93	€ 10,55
Erträge	€ 8	€ 8	€ 60.301
ausgegebene und umlaufende Anteile	1	1	6.036
NIW je Anteil	€ 9,14	€ 9,14	€ 9,99
Institutional GBP (Hedged): thesaurierend	£ 207.672	£ 3.280	£ 5.158
ausgegebene und umlaufende Anteile	19.400	316	475
NIW je Anteil	£ 10,70	£ 10,37	£ 10,85

	Zum 30. Jun. 2023	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021
	Low Duration Income Fund (Fortsetzung)		
Erträge	£ 106.712	£ 50.073	£ 130.935
ausgegebene und umlaufende Anteile	11.717	5.539	13.372
NIW je Anteil	£ 9,11	£ 9,04	£ 9,79
Institutional SGD (Hedged): thesaurierend	SGD 16.488	SGD 15.840	SGD 19.822
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.580	1.566	1.883
NIW je Anteil	SGD 10,43	SGD 10,12	SGD 10,53
Investor EUR (Hedged): thesaurierend	k. A.	k. A.	€ 639
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	k. A.	61
NIW je Anteil	k. A.	k. A.	€ 10,41
Erträge	k. A.	k. A.	€ 452
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	k. A.	48
NIW je Anteil	k. A.	k. A.	€ 9,46
E Class: thesaurierend	$ 45.350	$ 27.537	$ 16.491
ausgegebene und umlaufende Anteile	4.194	2.629	1.502
NIW je Anteil	$ 10,81	$ 10,47	$ 10,98
Erträge	$ 7.746	$ 8.193	$ 9.075
ausgegebene und umlaufende Anteile	831	885	904
NIW je Anteil	$ 9,32	$ 9,25	$ 10,04
E Class EUR (Hedged): thesaurierend	€ 58.816	€ 31.442	€ 16.611
ausgegebene und umlaufende Anteile	6.044	3.297	1.625
NIW je Anteil	€ 9,73	€ 9,54	€ 10,22
Erträge	€ 6.071	€ 2.708	€ 1.014
ausgegebene und umlaufende Anteile	725	322	109
NIW je Anteil	€ 8,38	€ 8,42	€ 9,34
E Class SGD (Hedged): Erträge	k. A.	k. A.	SGD 721
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	k. A.	73
NIW je Anteil	k. A.	k. A.	SGD 9,90
H Institutional: thesaurierend	$ 36.753	$ 62.043	$ 3.622
ausgegebene und umlaufende Anteile	3.509	6.136	344
NIW je Anteil	$ 10,47	$ 10,11	$ 10,53
Erträge	$ 556	$ 418	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	59	45	k. A.
NIW je Anteil	$ 9,45	$ 9,34	k. A.
Z Class EUR (Hedged): thesaurierend	€ 10	€ 9	€ 10
ausgegebene und umlaufende Anteile	1	1	1
NIW je Anteil	€ 10,49	€ 10,21	€ 10,79
	Low Duration Opportunities Fund		
Nettovermögen	$ 1.121.377	$ 1.345.781	$ 3.217.260
Institutional: thesaurierend	$ 138.843	$ 61.036	$ 142.348
ausgegebene und umlaufende Anteile	12.382	5.569	12.027
NIW je Anteil	$ 11,21	$ 10,96	$ 11,84

	Zum 30. Jun. 2023	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021
	Low Duration Opportunities Fund (Fortsetzung)		
Erträge	$ 25.000	$ 33.224	$ 41.508
ausgegebene und umlaufende Anteile	2.637	3.555	4.051
NIW je Anteil	$ 9,48	$ 9,35	$ 10,25
Institutional EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 16.304	€ 23.753	€ 41.652
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.682	2.478	3.940
NIW je Anteil	€ 9,69	€ 9,58	€ 10,57
Erträge	€ 5.089	€ 10.599	€ 12.374
ausgegebene und umlaufende Anteile	596	1.244	1.297
NIW je Anteil	€ 8,54	€ 8,52	€ 9,54
Institutional GBP (Hedged):			
thesaurierend	£ 497.866	£ 713.035	£ 1.734.093
ausgegebene und umlaufende Anteile	47.643	69.498	155.485
NIW je Anteil	£ 10,45	£ 10,26	£ 11,15
Erträge	£ 229.777	£ 288.970	£ 447.455
ausgegebene und umlaufende Anteile	25.362	31.985	44.752
NIW je Anteil	£ 9,06	£ 9,03	£ 10,00
Investor EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 4.060	€ 4.406	€ 8.109
ausgegebene und umlaufende Anteile	442	485	806
NIW je Anteil	€ 9,18	€ 9,09	€ 10,06
E Class EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 2.843	€ 3.102	€ 4.360
ausgegebene und umlaufende Anteile	319	350	443
NIW je Anteil	€ 8,93	€ 8,86	€ 9,84
Z Class:			
thesaurierend	$ 1.573	$ 1.534	$ 2.989
ausgegebene und umlaufende Anteile	166	166	301
NIW je Anteil	$ 9,48	$ 9,24	$ 9,93
	Low Duration Opportunities ESG Fund		
Nettovermögen	$ 5.017	$ 4.928	$
Institutional:			
thesaurierend	$ 4.491	$ 4.426	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	447	446	k. A.
NIW je Anteil	$ 10,05	$ 9,90	k. A.
Erträge	$ 10	$ 10	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	1	1	k. A.
NIW je Anteil	$ 9,79	$ 9,81	k. A.
Institutional EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 226	€ 225	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	23	23	k. A.
NIW je Anteil	€ 9,81	€ 9,78	k. A.
Erträge	€ 9	€ 9	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	1	1	k. A.
NIW je Anteil	€ 9,56	€ 9,69	k. A.
Institutional GBP (Hedged):			
thesaurierend	£ 197	£ 194	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	20	20	k. A.
NIW je Anteil	£ 9,95	£ 9,85	k. A.
Erträge	£ 8	£ 8	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	1	1	k. A.
NIW je Anteil	£ 9,66	£ 9,75	k. A.
	PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund		
Nettovermögen	$ 97.091	$ 120.137	$ 100.538
Institutional:			
thesaurierend	$ 13.729	$ 21.492	$ 21.487
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.297	2.114	2.658
NIW je Anteil	$ 10,59	$ 10,17	$ 8,08

	Zum 30. Jun. 2023	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021
	PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund (Fortsetzung)		
Erträge	$ 8.590	$ 10.469	$ 29.680
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.348	1.678	5.697
NIW je Anteil	$ 6,37	$ 6,24	$ 5,21
Institutional EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 36.472	€ 41.892	€ 19.141
ausgegebene und umlaufende Anteile	4.102	4.844	2.714
NIW je Anteil	€ 8,89	€ 8,65	€ 7,05
Erträge	€ 1.720	€ 3.309	€ 2.062
ausgegebene und umlaufende Anteile	323	625	455
NIW je Anteil	€ 5,33	€ 5,29	€ 4,54
Institutional GBP (Hedged):			
thesaurierend	£ 1.460	£ 1.415	£ 1.362
ausgegebene und umlaufende Anteile	161	162	193
NIW je Anteil	£ 9,08	£ 8,76	£ 7,07
Erträge	k. A.	k. A.	£ 25
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	k. A.	5
NIW je Anteil	k. A.	k. A.	£ 4,51
Investor:			
thesaurierend	k. A.	k. A.	$ 1.183
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	k. A.	117
NIW je Anteil	k. A.	k. A.	$ 10,09
E Class:			
Erträge	$ 21.107	$ 23.893	$ 10.905
ausgegebene und umlaufende Anteile	3.670	4.223	2.287
NIW je Anteil	$ 5,75	$ 5,66	$ 4,77
Z Class:			
thesaurierend	$ 10.141	$ 14.340	$ 11.293
ausgegebene und umlaufende Anteile	752	1.113	1.113
NIW je Anteil	$ 13,48	$ 12,88	$ 10,14
	Mortgage Opportunities Fund		
Nettovermögen	$ 620.336	$ 849.148	$ 2.238.424
Institutional:			
thesaurierend	$ 314.026	$ 409.011	$ 558.563
ausgegebene und umlaufende Anteile	28.587	38.104	47.581
NIW je Anteil	$ 10,98	$ 10,73	$ 11,74
Erträge	$ 31.854	$ 94.373	$ 351.769
ausgegebene und umlaufende Anteile	3.619	10.759	35.231
NIW je Anteil	$ 8,80	$ 8,77	$ 9,98
Institutional CAD (Hedged):			
thesaurierend	CAD 23.924	CAD 23.438	CAD 25.659
ausgegebene und umlaufende Anteile	2.532	2.532	2.532
NIW je Anteil	CAD 9,45	CAD 9,26	CAD 10,14
Institutional CHF (Hedged):			
thesaurierend	CHF 2.590	CHF 3.010	CHF 5.577
ausgegebene und umlaufende Anteile	277	322	532
NIW je Anteil	CHF 9,36	CHF 9,34	CHF 10,47
Institutional EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 119.415	€ 192.977	€ 317.357
ausgegebene und umlaufende Anteile	12.364	20.209	29.769
NIW je Anteil	€ 9,66	€ 9,55	€ 10,66
Erträge	€ 11.593	€ 14.970	€ 26.722
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.500	1.923	2.953
NIW je Anteil	€ 7,73	€ 7,78	€ 9,05
Institutional GBP (Hedged):			
thesaurierend	£ 6.109	£ 7.355	£ 19.288
ausgegebene und umlaufende Anteile	592	727	1.733
NIW je Anteil	£ 10,31	£ 10,12	£ 11,13
Erträge	£ 4.675	£ 6.104	£ 5.764
ausgegebene und umlaufende Anteile	567	740	609
NIW je Anteil	£ 8,24	£ 8,25	£ 9,46

	Zum 30. Jun. 2023	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021
	Mortgage Opportunities Fund (Fortsetzung)		
Investor:			
thesaurierend	$ 21.447	$ 20.219	$ 32.611
ausgegebene und umlaufende Anteile	2.038	1.963	2.885
NIW je Anteil	$ 10,52	$ 10,30	$ 11,30
Erträge	$ 4.731	$ 4.762	$ 19.104
ausgegebene und umlaufende Anteile	538	543	1.914
NIW je Anteil	$ 8,80	$ 8,77	$ 9,98
Administrative:			
Erträge	$ 3.190	$ 44	$ 540
ausgegebene und umlaufende Anteile	362	5	54
NIW je Anteil	$ 8,80	$ 8,77	$ 9,98
E Class:			
thesaurierend	$ 46.140	$ 43.823	$ 58.797
ausgegebene und umlaufende Anteile	4.447	4.304	5.232
NIW je Anteil	$ 10,38	$ 10,18	$ 11,24
Erträge	$ 6.086	$ 4.351	$ 10.154
ausgegebene und umlaufende Anteile	692	496	1.017
NIW je Anteil	$ 8,79	$ 8,77	$ 9,99
E Class CHF (Hedged):			
Erträge	CHF 228	CHF 166	CHF 319
ausgegebene und umlaufende Anteile	31	22	36
NIW je Anteil	CHF 7,43	CHF 7,55	CHF 8,82
E Class EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 13.696	€ 12.803	€ 16.220
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.503	1.415	1.591
NIW je Anteil	€ 9,11	€ 9,05	€ 10,20
Erträge	k. A.	k. A.	€ 151
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	k. A.	17
NIW je Anteil	k. A.	k. A.	€ 8,98
E Class SGD (Hedged):			
Erträge	k. A.	k. A.	SGD 1.645
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	k. A.	168
NIW je Anteil	k. A.	k. A.	SGD 9,78
H Institutional:			
thesaurierend	$ 40	$ 39	$ 71
ausgegebene und umlaufende Anteile	4	4	7
NIW je Anteil	$ 10,11	$ 9,88	$ 10,83
Z Class:			
thesaurierend	$ 10	$ 10	$ 214.716
ausgegebene und umlaufende Anteile	1	1	19.628
NIW je Anteil	$ 10,04	$ 9,78	$ 10,94
Z Class GBP (Hedged):			
thesaurierend	k. A.	k. A.	£ 384.109
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	k. A.	34.658
NIW je Anteil	k. A.	k. A.	£ 11,08
	StocksPLUS™ Fund		
Nettovermögen	$ 1.803.959	$ 1.008.739	$ 3.761.156
Institutional:			
thesaurierend	$ 1.141.405	$ 581.668	$ 2.349.757
ausgegebene und umlaufende Anteile	20.867	12.422	39.164
NIW je Anteil	$ 54,70	$ 46,83	$ 60,00

	Zum 30. Jun. 2023	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021
	StocksPLUS™ Fund (Fortsetzung)		
Erträge	$ 28.551	$ 24.829	$ 39.901
ausgegebene und umlaufende Anteile	735	734	913
NIW je Anteil	$ 38,84	$ 33,81	$ 43,69
Institutional EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 106.679	€ 131.649	€ 570.050
ausgegebene und umlaufende Anteile	3.479	4.953	16.237
NIW je Anteil	€ 30,66	€ 26,58	€ 35,11
Erträge	k. A.	k. A.	€ 2.081
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	k. A.	68
NIW je Anteil	k. A.	k. A.	€ 30,66
Institutional GBP (Hedged):			
thesaurierend	£ 278	£ 3.922	£ 199
ausgegebene und umlaufende Anteile	28	456	18
NIW je Anteil	£ 9,98	£ 8,60	£ 11,28
Institutional SGD (Hedged):			
thesaurierend	SGD 437	SGD 335	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	43	38	k. A.
NIW je Anteil	SGD 10,18	SGD 8,76	k. A.
Investor:			
thesaurierend	$ 29.245	$ 19.778	$ 21.609
ausgegebene und umlaufende Anteile	581	458	389
NIW je Anteil	$ 50,34	$ 43,17	$ 55,51
BE Retail:			
thesaurierend	$ 4.897	$ 9	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	489	1	k. A.
NIW je Anteil	$ 10,01	$ 8,66	k. A.
E Class:			
thesaurierend	$ 188.944	$ 165.517	$ 175.651
ausgegebene und umlaufende Anteile	4.012	4.087	3.355
NIW je Anteil	$ 47,09	$ 40,50	$ 52,35
E Class EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 73.824	€ 35.366	€ 13.927
ausgegebene und umlaufende Anteile	4.784	2.632	777
NIW je Anteil	€ 15,43	€ 13,44	€ 17,91
H Institutional:			
thesaurierend	$ 213.312	$ 33.724	$ 504.831
ausgegebene und umlaufende Anteile	15.626	2.884	33.635
NIW je Anteil	$ 13,65	$ 11,69	$ 15,01
T Class:			
thesaurierend	k. A.	k. A.	$ 2.673
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	k. A.	124
NIW je Anteil	k. A.	k. A.	$ 21,50
	PIMCO StocksPLUS™ AR Fund		
Nettovermögen	$ 11.547	$ 9.528	$ 11.610
Institutional:			
thesaurierend	$ 10.552	$ 9.327	$ 10.848
ausgegebene und umlaufende Anteile	640	663	603
NIW je Anteil	$ 16,49	$ 14,07	$ 17,97
Institutional EUR (Hedged):			
thesaurierend	k. A.	k. A.	€ 405
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	k. A.	24
NIW je Anteil	k. A.	k. A.	€ 17,09
Institutional GBP (Hedged):			
thesaurierend	£ 783	£ 167	£ 198
ausgegebene und umlaufende Anteile	78	19	18
NIW je Anteil	£ 10,02	£ 8,59	£ 11,24
E Class:			
thesaurierend	k. A.	k. A.	$ 34
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	k. A.	2
NIW je Anteil	k. A.	k. A.	$ 17,53

	Zum 30. Jun. 2023	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021
	Strategic Income Fund		
Nettovermögen	$ 461.936	$ 506.557	$ 619.928
Institutional:			
thesaurierend	$ 20.699	$ 21.761	$ 33.080
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.783	1.939	2.754
NIW je Anteil	$ 11,61	$ 11,22	$ 12,01
Institutional EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 150.032	€ 168.023	€ 207.426
ausgegebene und umlaufende Anteile	11.466	13.134	14.906
NIW je Anteil	€ 13,08	€ 12,79	€ 13,92
Institutional GBP (Hedged):			
Erträge	£ 207	£ 201	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	21	21	k. A.
NIW je Anteil	£ 9,69	£ 9,67	k. A.
E Class:			
thesaurierend	$ 34.553	$ 37.001	$ 35.991
ausgegebene und umlaufende Anteile	2.526	2.786	2.509
NIW je Anteil	$ 13,68	$ 13,28	$ 14,34
ausschüttend II	$ 16.928	$ 18.150	$ 18.959
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.850	1.989	1.828
NIW je Anteil	$ 9,15	$ 9,13	$ 10,37
E Class EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 115.914	€ 133.817	€ 140.034
ausgegebene und umlaufende Anteile	9.670	11.367	10.837
NIW je Anteil	€ 11,99	€ 11,77	€ 12,92
ausschüttend II	€ 70.389	€ 76.984	€ 94.373
ausgegebene und umlaufende Anteile	8.787	9.528	10.105
NIW je Anteil	€ 8,01	€ 8,08	€ 9,34
T Class EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 14.079	€ 15.503	€ 17.708
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.319	1.475	1.529
NIW je Anteil	€ 10,68	€ 10,51	€ 11,58
Erträge	€ 6.591	€ 8.019	€ 8.185
ausgegebene und umlaufende Anteile	747	908	817
NIW je Anteil	€ 8,83	€ 8,83	€ 10,02
	Total Return Bond Fund		
Nettovermögen	$ 4.326.369	$ 4.150.717	$ 4.944.898
Institutional:			
thesaurierend	$ 1.531.261	$ 1.419.973	$ 1.598.195
ausgegebene und umlaufende Anteile	51.909	49.161	46.882
NIW je Anteil	$ 29,50	$ 28,88	$ 34,09
Erträge	$ 117.500	$ 112.085	$ 174.533
ausgegebene und umlaufende Anteile	7.962	7.634	9.829
NIW je Anteil	$ 14,76	$ 14,68	$ 17,76
Institutional CAD (Hedged):			
Erträge	CAD 9.498	CAD 13.555	CAD 26.323
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.110	1.587	2.540
NIW je Anteil	CAD 8,56	CAD 8,54	CAD 10,36
Institutional CHF (Hedged):			
thesaurierend	CHF 3.894	CHF 3.138	CHF 13.206
ausgegebene und umlaufende Anteile	398	320	1.111
NIW je Anteil	CHF 9,79	CHF 9,79	CHF 11,88

	Zum 30. Jun. 2023	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021
	Total Return Bond Fund (Fortsetzung)		
Institutional EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 409.399	€ 388.231	€ 358.693
ausgegebene und umlaufende Anteile	20.980	20.056	15.344
NIW je Anteil	€ 19,51	€ 19,36	€ 23,38
Erträge	€ 208.583	€ 212.408	€ 260.110
ausgegebene und umlaufende Anteile	17.935	18.120	17.931
NIW je Anteil	€ 11,63	€ 11,72	€ 14,51
Institutional EUR (Unhedged):			
thesaurierend	€ 8.546	€ 19.929	€ 14.618
ausgegebene und umlaufende Anteile	316	736	488
NIW je Anteil	€ 27,04	€ 27,06	€ 29,97
Institutional GBP (Hedged):			
thesaurierend	£ 5.834	£ 3.621	£ 5.534
ausgegebene und umlaufende Anteile	469	296	379
NIW je Anteil	£ 12,44	£ 12,24	£ 14,59
Erträge	£ 20.149	£ 29.067	£ 43.763
ausgegebene und umlaufende Anteile	2.455	3.543	4.355
NIW je Anteil	£ 8,21	£ 8,20	£ 10,05
Institutional ILS (Hedged):			
thesaurierend	k. A.	k. A.	ILS 185
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	k. A.	13
NIW je Anteil	k. A.	k. A.	ILS 14,41
Institutional SGD (Hedged):			
thesaurierend	SGD 7.447	SGD 7.941	SGD 21.940
ausgegebene und umlaufende Anteile	603	652	1.524
NIW je Anteil	SGD 12,35	SGD 12,17	SGD 14,40
Investor:			
thesaurierend	$ 374.957	$ 409.533	$ 369.122
ausgegebene und umlaufende Anteile	13.866	15.440	11.750
NIW je Anteil	$ 27,04	$ 26,52	$ 31,41
Erträge	$ 67.805	$ 67.693	$ 35.775
ausgegebene und umlaufende Anteile	4.530	4.545	1.987
NIW je Anteil	$ 14,97	$ 14,89	$ 18,01
Investor CHF (Hedged):			
thesaurierend	CHF 2.805	CHF 2.893	CHF 4.784
ausgegebene und umlaufende Anteile	299	307	417
NIW je Anteil	CHF 9,39	CHF 9,41	CHF 11,46
Investor EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 17.802	€ 18.868	€ 19.262
ausgegebene und umlaufende Anteile	973	1.038	874
NIW je Anteil	€ 18,30	€ 18,18	€ 22,03
Administrative:			
thesaurierend	$ 134.057	$ 130.283	$ 159.690
ausgegebene und umlaufende Anteile	5.025	4.975	5.141
NIW je Anteil	$ 26,68	$ 26,19	$ 31,06
Erträge	$ 50.367	$ 4.583	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	5.268	482	k. A.
NIW je Anteil	$ 9,56	$ 9,51	k. A.
Administrative EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 3.007	€ 2.966	€ 1.953
ausgegebene und umlaufende Anteile	276	273	148
NIW je Anteil	€ 10,91	€ 10,84	€ 13,16
Administrative SGD (Hedged):			
Erträge	SGD 14	k. A.	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	1	k. A.	k. A.
NIW je Anteil	SGD 9,93	k. A.	k. A.
E Class:			
thesaurierend	$ 422.590	$ 380.803	$ 478.210
ausgegebene und umlaufende Anteile	16.734	15.332	16.167
NIW je Anteil	$ 25,25	$ 24,84	$ 29,58
Erträge	$ 149.005	$ 151.164	$ 199.962
ausgegebene und umlaufende Anteile	13.266	13.526	14.801
NIW je Anteil	$ 11,23	$ 11,18	$ 13,51

	Zum 30. Jun. 2023	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021
	Total Return Bond Fund (Fortsetzung)		
E Class CHF (Hedged):			
thesaurierend	CHF 11.034	CHF 9.731	CHF 5.648
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.329	1.166	553
NIW je Anteil	CHF 8,30	CHF 8,34	CHF 10,22
E Class EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 452.255	€ 471.035	€ 623.265
ausgegebene und umlaufende Anteile	27.052	28.276	30.705
NIW je Anteil	€ 16,72	€ 16,66	€ 20,30
Erträge	€ 37.051	€ 40.476	€ 54.687
ausgegebene und umlaufende Anteile	4.777	5.177	5.655
NIW je Anteil	€ 7,76	€ 7,82	€ 9,67
E Class EUR (Unhedged):			
thesaurierend	€ 191	€ 489	€ 710
ausgegebene und umlaufende Anteile	20	51	67
NIW je Anteil	€ 9,48	€ 9,53	€ 10,65
E Class HKD (Unhedged):			
thesaurierend	k. A.	HKD 1.568	HKD 3.128
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	155	259
NIW je Anteil	k. A.	HKD 10,15	HKD 12,07
E Class SGD (Hedged):			
thesaurierend	SGD 29.383	SGD 30.035	SGD 38.699
ausgegebene und umlaufende Anteile	802	828	894
NIW je Anteil	SGD 36,64	SGD 36,28	SGD 43,30
H Institutional:			
thesaurierend	$ 117.434	$ 115.199	$ 199.555
ausgegebene und umlaufende Anteile	4.112	4.116	6.033
NIW je Anteil	$ 28,56	$ 27,98	$ 33,08
Erträge	$ 9.231	$ 8.589	$ 17.255
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.020	954	1.585
NIW je Anteil	$ 9,05	$ 9,00	$ 10,89
M Retail HKD (Unhedged):			
Erträge	HKD 82.672	HKD 76.242	HKD 91.252
ausgegebene und umlaufende Anteile	9.270	8.622	8.552
NIW je Anteil	HKD 8,92	HKD 8,84	HKD 10,67
R Class EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 2.553	€ 2.836	€ 5.974
ausgegebene und umlaufende Anteile	275	308	535
NIW je Anteil	€ 9,28	€ 9,22	€ 11,16
T Class:			
thesaurierend	$ 6.107	$ 6.382	$ 13.697
ausgegebene und umlaufende Anteile	615	652	1.172
NIW je Anteil	$ 9,93	$ 9,79	$ 11,69
T Class EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 4.745	€ 4.426	€ 4.561
ausgegebene und umlaufende Anteile	555	518	437
NIW je Anteil	€ 8,56	€ 8,54	€ 10,44
	PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund		
Nettovermögen	$ 302.364	$ 435.924	$ 101.789
Institutional:			
thesaurierend	$ 98.805	$ 183.555	$ 70.982
ausgegebene und umlaufende Anteile	7.881	14.361	6.152
NIW je Anteil	$ 12,54	$ 12,78	$ 11,54
Institutional EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 32.375	€ 121.520	€ 11.436
ausgegebene und umlaufende Anteile	2.955	10.765	1.108
NIW je Anteil	€ 10,96	€ 11,29	€ 10,32
Institutional GBP (Hedged):			
thesaurierend	£ 301	£ 9	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	31	1	k. A.
NIW je Anteil	£ 9,66	£ 9,88	k. A.

	Zum 30. Jun. 2023	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021
	PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund (Fortsetzung)		
Erträge	£ 66.524	£ 31.132	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	7.397	3.333	k. A.
NIW je Anteil	£ 8,99	£ 9,34	k. A.
Investor:			
thesaurierend	$ 4.667	$ 9	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	506	1	k. A.
NIW je Anteil	$ 9,23	$ 9,43	k. A.
Investor EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 9	€ 9	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	1	1	k. A.
NIW je Anteil	€ 9,10	€ 9,39	k. A.
E Class:			
thesaurierend	$ 9.234	$ 11.079	$ 2.886
ausgegebene und umlaufende Anteile	804	941	269
NIW je Anteil	$ 11,49	$ 11,78	$ 10,74
E Class EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 15.563	€ 17.465	€ 1.747
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.551	1.680	182
NIW je Anteil	€ 10,04	€ 10,40	€ 9,61
H Institutional:			
thesaurierend	$ 549	$ 43	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	55	4	k. A.
NIW je Anteil	$ 9,93	$ 10,13	k. A.
Z Class:			
thesaurierend	$ 51.840	$ 55.435	$ 12.929
ausgegebene und umlaufende Anteile	4.695	4.958	1.299
NIW je Anteil	$ 11,04	$ 11,18	$ 9,95
	UK Corporate Bond Fund		
Nettovermögen	£ 334.835	£ 389.173	£ 592.164
Institutional:			
thesaurierend	£ 41.367	£ 46.355	£ 75.231
ausgegebene und umlaufende Anteile	2.293	2.532	3.348
NIW je Anteil	£ 18,04	£ 18,31	£ 22,47
Erträge	£ 228.419	£ 276.939	£ 436.466
ausgegebene und umlaufende Anteile	28.029	32.956	41.393
NIW je Anteil	£ 8,15	£ 8,40	£ 10,54
Z Class:			
thesaurierend	£ 65.049	£ 65.879	£ 80.467
ausgegebene und umlaufende Anteile	7.715	7.715	7.715
NIW je Anteil	£ 8,43	£ 8,54	£ 10,43
	UK Long Term Corporate Bond Fund		
Nettovermögen	£ 297.912	£ 325.020	£ 425.748
Institutional:			
thesaurierend	£ 260.414	£ 283.958	£ 366.869
ausgegebene und umlaufende Anteile	13.674	14.455	13.155
NIW je Anteil	£ 19,04	£ 19,65	£ 27,89
Erträge	£ 37.498	£ 41.062	£ 58.879
ausgegebene und umlaufende Anteile	3.516	3.656	3.578
NIW je Anteil	£ 10,67	£ 11,23	£ 16,45
	US High Yield Bond Fund		
Nettovermögen	$ 1.977.601	$ 1.984.922	$ 3.923.786
Institutional:			
thesaurierend	$ 759.077	$ 780.024	$ 1.665.090
ausgegebene und umlaufende Anteile	20.125	21.785	40.803
NIW je Anteil	$ 37,72	$ 35,80	$ 40,81
Erträge	$ 210.079	$ 233.780	$ 400.716
ausgegebene und umlaufende Anteile	24.484	27.877	39.668
NIW je Anteil	$ 8,58	$ 8,39	$ 10,10

	Zum 30. Jun. 2023	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021
	US High Yield Bond Fund (Fortsetzung)		
Institutional CHF (Hedged):			
thesaurierend	k. A.	k. A.	CHF 2.738
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	k. A.	222
NIW je Anteil	k. A.	k. A.	CHF 12,33
Institutional EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 232.152	€ 240.268	€ 482.095
ausgegebene und umlaufende Anteile	8.184	8.811	15.170
NIW je Anteil	€ 28,37	€ 27,27	€ 31,78
Erträge	€ 35.376	€ 33.678	€ 138.522
ausgegebene und umlaufende Anteile	3.658	3.520	11.751
NIW je Anteil	€ 9,67	€ 9,57	€ 11,79
Institutional GBP (Hedged):			
thesaurierend	£ 45.055	£ 40.143	£ 48.533
ausgegebene und umlaufende Anteile	2.048	1.913	2.009
NIW je Anteil	£ 22,00	£ 20,99	£ 24,16
Erträge	£ 2.131	£ 1.108	£ 5.115
ausgegebene und umlaufende Anteile	260	138	522
NIW je Anteil	£ 8,18	£ 8,04	£ 9,80
Institutional SGD (Hedged):			
thesaurierend	k. A.	k. A.	SGD 374
ausgegebene und umlaufende Anteile	k. A.	k. A.	37
NIW je Anteil	k. A.	k. A.	SGD 10,10
Investor:			
thesaurierend	$ 239.743	$ 236.934	$ 434.782
ausgegebene und umlaufende Anteile	7.133	7.413	11.894
NIW je Anteil	$ 33,61	$ 31,96	$ 36,56
Erträge	$ 20.137	$ 20.862	$ 37.431
ausgegebene und umlaufende Anteile	2.899	3.073	4.581
NIW je Anteil	$ 6,95	$ 6,79	$ 8,17
Investor EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 3.102	€ 2.708	€ 3.173
ausgegebene und umlaufende Anteile	121	110	110
NIW je Anteil	€ 25,54	€ 24,59	€ 28,78
E Class:			
thesaurierend	$ 128.310	$ 132.559	$ 225.933
ausgegebene und umlaufende Anteile	3.970	4.302	6.375
NIW je Anteil	$ 32,32	$ 30,82	$ 35,44
Erträge	$ 68.092	$ 58.679	$ 124.742
ausgegebene und umlaufende Anteile	7.436	6.557	11.581
NIW je Anteil	$ 9,16	$ 8,95	$ 10,77
E Class EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 54.724	€ 56.406	€ 77.393
ausgegebene und umlaufende Anteile	2.254	2.407	2.808
NIW je Anteil	€ 24,27	€ 23,44	€ 27,56
H Institutional:			
thesaurierend	$ 108.402	$ 88.253	$ 139.658
ausgegebene und umlaufende Anteile	2.974	2.548	3.532
NIW je Anteil	$ 36,45	$ 34,63	$ 39,54
Erträge	$ 3.410	$ 2.482	$ 3.370
ausgegebene und umlaufende Anteile	402	299	337
NIW je Anteil	$ 8,49	$ 8,29	$ 9,99
M Retail:			
Erträge	$ 12.208	$ 12.265	$ 4.154
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.315	1.351	381
NIW je Anteil	$ 9,28	$ 9,08	$ 10,91
R Class:			
thesaurierend	$ 4.183	$ 5.477	$ 4.914
ausgegebene und umlaufende Anteile	281	387	304
NIW je Anteil	$ 14,90	$ 14,17	$ 16,18

	Zum 30. Jun. 2023	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021
	US High Yield Bond Fund (Fortsetzung)		
Z Class:			
thesaurierend	$ 9.008	$ 8.528	$ 9.666
ausgegebene und umlaufende Anteile	661	661	661
NIW je Anteil	$ 13,63	$ 12,91	$ 14,63
	US Investment Grade Corporate Bond Fund		
Nettovermögen	$ 444.793	$ 388.522	$ 878.100
Institutional:			
thesaurierend	$ 190.969	$ 151.061	$ 132.646
ausgegebene und umlaufende Anteile	17.423	14.307	10.461
NIW je Anteil	$ 10,96	$ 10,56	$ 12,68
Erträge	$ 68.975	$ 61.577	$ 63.781
ausgegebene und umlaufende Anteile	7.918	7.201	5.999
NIW je Anteil	$ 8,71	$ 8,55	$ 10,63
Institutional EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 101.292	€ 124.155	€ 214.560
ausgegebene und umlaufende Anteile	10.706	13.447	18.908
NIW je Anteil	€ 9,46	€ 9,23	€ 11,35
Institutional GBP (Hedged):			
ausschüttend II	£ 22.892	£ 13.692	£ 304.200
ausgegebene und umlaufende Anteile	2.968	1.794	31.489
NIW je Anteil	£ 7,71	£ 7,63	£ 9,66
E Class:			
thesaurierend	$ 37.293	$ 21.852	$ 17.627
ausgegebene und umlaufende Anteile	4.134	2.504	1.667
NIW je Anteil	$ 9,02	$ 8,73	$ 10,58
Erträge	$ 6.769	$ 5.002	$ 8.025
ausgegebene und umlaufende Anteile	765	576	743
NIW je Anteil	$ 8,85	$ 8,68	$ 10,80
H Institutional:			
thesaurierend	$ 1.173	$ 55	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	116	6	k. A.
NIW je Anteil	$ 10,09	$ 9,73	k. A.
	US Short-Term Fund		
Nettovermögen	$ 2.066.904	$ 2.310.115	$ 2.650.198
Institutional:			
thesaurierend	$ 720.990	$ 865.421	$ 835.096
ausgegebene und umlaufende Anteile	61.864	76.197	73.558
NIW je Anteil	$ 11,65	$ 11,36	$ 11,35
Erträge	$ 121.354	$ 131.027	$ 102.552
ausgegebene und umlaufende Anteile	12.150	13.207	10.172
NIW je Anteil	$ 9,99	$ 9,92	$ 10,08
Institutional EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 101.825	€ 202.833	€ 233.199
ausgegebene und umlaufende Anteile	10.126	20.470	23.092
NIW je Anteil	€ 10,06	€ 9,91	€ 10,10
Institutional GBP (Hedged):			
Erträge	£ 201	k. A.	k. A.
ausgegebene und umlaufende Anteile	20	k. A.	k. A.
NIW je Anteil	£ 10,05	k. A.	k. A.
Investor:			
thesaurierend	$ 10.504	$ 12.829	$ 18.474
ausgegebene und umlaufende Anteile	930	1.164	1.671
NIW je Anteil	$ 11,29	$ 11,02	$ 11,06
E Class:			
thesaurierend	$ 434.206	$ 412.347	$ 467.026
ausgegebene und umlaufende Anteile	38.580	37.521	42.334
NIW je Anteil	$ 11,25	$ 10,99	$ 11,03
E Class EUR (Hedged):			
thesaurierend	€ 35.124	€ 44.471	€ 9.227
ausgegebene und umlaufende Anteile	3.631	4.656	944
NIW je Anteil	€ 9,67	€ 9,55	€ 9,77

	Zum 30. Jun. 2023	Zum 31. Dez. 2022	Zum 31. Dez. 2021
	US Short-Term Fund (Fortsetzung)		
H Institutional:			
thesaurierend	$ 17.510	$ 22.367	$ 33.914
ausgegebene und umlaufende Anteile	1.639	2.147	3.250
NIW je Anteil	$ 10,68	$ 10,42	$ 10,44
Z Class:			
Erträge	$ 612.674	$ 602.189	$ 917.450
ausgegebene und umlaufende Anteile	61.012	60.375	90.541
NIW je Anteil	$ 10,04	$ 9,97	$ 10,13

17. VERGÜTUNG

Die Verwaltungsgesellschaft wendet eine Vergütungspolitik an, die den geltenden OGAW-Anforderungen entspricht und im Prospekt zusammengefasst ist.

Weitere Einzelheiten zur Vergütung der Gesellschaft sowie entsprechende finanzielle Angaben werden im geprüften Jahresabschluss für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 bereitgestellt.

18. RECHTSSTREITIGKEITEN UND AUFSICHTSRECHTLICHE ANGELEGENHEITEN

Die Gesellschaft ist nicht als Beklagte an wesentlichen Rechtsstreitigkeiten oder Schiedsgerichtsverfahren beteiligt und ihr sind etwaige solche gegen sie bestehenden oder drohenden wesentlichen Rechtsstreitigkeiten oder Schadensersatzforderungen nicht bekannt.

Die vorstehenden Ausführungen beziehen sich nur auf den Stand vom 30. Juni 2023.

19. KREDITFAZILITÄT

PIMCO Funds: Global Investors Series plc hat am 19. August 2022 im Auftrag der Fonds Global High Yield Bond Fund und US High Yield Bond Fund (die „Fonds“, jeder für sich ein „Fonds“) eine dritte geänderte und neu gefasste Kreditfazilität (die „Kreditvereinbarung“) u. a. zwischen den Fonds, bestimmten Kreditgebern, zu denen auch die MUFG Bank Ltd. („MUFG“) (als Kreditgeber) zählt, und MUFG (als Verwahrstelle und Konsortialführerin) abgeschlossen.

Jeder Fonds darf die Fazilität für temporäre Zwecke nutzen, um Rücknahmen durch Anteilinhaber zu finanzieren, sowie für andere kurzfristige Liquiditätszwecke gemäß seiner Anlagepolitik.

Der Gesamtbetrag, der für eine Nutzung durch die Fonds zur Verfügung steht, beläuft sich vorbehaltlich der Bestimmungen der Kreditvereinbarung auf 285.000.000 USD. Der Gesamtbetrag, der den Fonds zusammen mit den anderen Kreditnehmern (zusammen die „Kreditnehmer“) zur Verfügung steht, unterliegt den Bedingungen der Kreditvereinbarung 300.500.000 USD (der „zugesagte Gesamtbetrag“). Die Kreditnehmer können vorbehaltlich der Bedingungen der Kreditvereinbarung eine Erhöhung um bis zu 299.500.000 USD auf den zugesagten Gesamtbetrag verlangen. Dieser erhöhte zugesagte Betrag würde den Kreditnehmern zur Inanspruchnahme gemäß den Bestimmungen der Kreditvereinbarung zur Verfügung stehen.

Die Kreditvereinbarung sieht zwei verschiedene Zinssätze vor. Bei der Inanspruchnahme eines Kredits entscheidet jeder Fonds selbst, welcher Zinssatz für das gesamte oder einen Teil des jeweiligen Darlehen gilt. Hierbei wird der geltende Zinssatz durch Bezugnahme auf (i) die Alternate Base Rate oder (ii) die Adjusted Daily Simple SOFR bestimmt.

Der Alternate Base Rate gilt für jeden Tag, je nachdem, welcher Wert höher ist: (i) Federal Funds Rate (wie in der Kreditvereinbarung festgelegt) oder (ii) der Overnight Bank Funding Rate (wie in der Kreditvereinbarung festgelegt), wie an diesem Datum gültig. Für jeden unter Bezugnahme auf den Alternate Base Rate berechneten Kreditnennbetrag werden Zinsen auf den ausstehenden Kapitalbetrag erhoben, und zwar für den Zeitraum vom Tag der Gewährung des Kredits bis u. a. zu dem Datum, an dem der Kredit vollständig zu einem bestimmten Zinssatz zurückgezahlt wird, und zwar in Höhe des Alternate Base Rate zzgl. der geltenden Marge (1,125 %).

Der Adjusted Daily Simple SOFR ist ein Zinssatz pro Jahr, der dem (a) Daily Simple SOFR (wie in der Kreditvereinbarung festgelegt) zzgl. (b) 0,10 % entspricht. Für jeden unter Bezugnahme auf den Adjusted Daily Simple SOFR berechneten Kreditnennbetrag werden Zinsen auf den ausstehenden Kapitalbetrag erhoben, und zwar für den Zeitraum vom Tag der Gewährung oder der Fortführung des Kredits bis einschließlich zu dem Datum, an dem der Kredit vollständig zu einem bestimmten Zinssatz zurückgezahlt wird, und zwar in Höhe des Adjusted Daily Simple SOFR zuzüglich der geltenden Marge (1,125 %).

Jeder Kredit ist vorbehaltlich der Bestimmungen der Kreditvereinbarungen innerhalb von 60 Tagen nach Inanspruchnahme zurückzuzahlen.

Sämtliche Kredite werden auf unbesicherter Basis gewährt, und der Rückgriff der Kreditgeber gegenüber einem Fonds ist auf die Vermögenswerte des betreffenden Fonds beschränkt.

Zum 30. Juni 2023 und zum 31. Dezember 2022 hatte keiner der Fonds im Rahmen der Kreditvereinbarung Kredite in Anspruch genommen.

20. VERORDNUNG ÜBER WERTPAPIERFINANZIERUNGSGESCHÄFTE

Die Verordnung über Transparenz von Wertpapierfinanzierungsgeschäften (Securities Financing Transactions Regulation, „SFTR“) führt Melde- und Offenlegungspflichten für Wertpapierfinanzierungsgeschäfte (Securities Financing Transactions, „SFT“) und Total Return Swaps ein. SFTs sind gemäß Artikel 3(11) der SFTR folgendermaßen konkret definiert:

- Pensionsgeschäfte/umgekehrte Pensionsgeschäfte
- Wertpapier- oder Rohstoffleihgeschäfte
- Buy-Sellback- oder Sale-Buyback-Geschäfte oder
- Lombardgeschäfte

(a) Globale Daten und Konzentration von SFT-Kontrahenten

Zum 30. Juni 2023 hielten die Fonds Total Return Swaps und die folgenden Arten von SFTs:

- Pensionsgeschäfte
- Umgekehrte Pensionsgeschäfte
- Sale-Buyback-Geschäfte

Der Marktwert von Vermögenswerten/(Verbindlichkeiten) über alle SFTs und Total Return Swaps hinweg, jeweils gruppiert nach SFT-Art(en), und die zehn größten Kontrahenten gestalteten sich zum 30. Juni 2023 wie nachfolgend angegeben (wenn weniger als zehn Kontrahenten verwendet werden, sind alle Kontrahenten aufgeführt).

	30. Jun. 2023	
Fonds	Marktwert (000S)	% des Nettovermögens
PIMCO Asia High Yield Bond Fund		
Pensionsgeschäfte		
SSB	$ 7.016	0,25
Asia Strategic Interest Bond Fund		
Pensionsgeschäfte		
SSB	$ 347	0,11
PIMCO Capital Securities Fund		
Pensionsgeschäfte		
NOM	$ 25.100	0,46
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
BPS	(37.940)	(0,70)
BRC	(4.872)	(0,09)
JML	(117.913)	(2,16)
NOM	(4.768)	(0,09)
SCX	(87.890)	(1,61)
Summe	(253.383)	(4,65)
PIMCO Climate Bond Fund		
Pensionsgeschäfte		
BOS	$ 34.000	11,74
Commodity Real Return Fund		
Total Return Swaps		
BPS	$ (3.069)	(0,31)
CBK	(4.652)	(0,49)
CIB	(818)	(0,08)
FBF	(380)	(0,04)
GST	(6.440)	(0,66)
JPM	(1.310)	(0,13)
MAC	(856)	(0,09)
MEI	(527)	(0,05)
SOG	(44)	0,00
Summe	(18.096)	(1,85)

Fonds		30. Jun. 2023 Marktwert (000S)	% des Nettovermögens
Commodity Real Return Fund (Fortsetzung)			
Pensionsgeschäfte			
FICC	$	2.394	0,25
Umgekehrte Pensionsgeschäfte			
BOS		(220.439)	(22,65)
GRE		(107.859)	(11,08)
IND		(10.956)	(1,13)
Summe		(339.254)	(34,86)
Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte			
BPG		(13.250)	(1,36)
TDM		(9.831)	(1,01)
Summe		(23.081)	(2,37)
PIMCO Credit Opportunities Bond Fund			
Total Return Swaps			
BPS	$	7	0,01
Pensionsgeschäfte			
BPS		12.600	12,63
SSB		553	0,55
Summe		13.153	13,18
Diversified Income Fund			
Pensionsgeschäfte			
BPS	$	251.600	3,17
BRC		842.700	10,62
FICC		105.437	1,33
MBC		36.100	0,45
TDM		800	0,01
Summe		1.236.637	15,58
Umgekehrte Pensionsgeschäfte			
BRC		(19.918)	(0,25)
JML		(26.154)	(0,33)
MYI		(17.123)	(0,22)
Summe		(63.195)	(0,80)
Diversified Income Duration Hedged Fund			
Pensionsgeschäfte			
BOS	$	91.100	17,47
BPS		13.000	2,49
FICC		3.266	0,63
Summe		107.366	20,59
Umgekehrte Pensionsgeschäfte			
JML		(368)	(0,07)
Diversified Income ESG Fund			
Pensionsgeschäfte			
MBC	$	7.400	12,76
Dynamic Bond Fund			
Pensionsgeschäfte			
BRC	$	466.900	13,87
FICC		3.658	0,11
SAL		85.300	2,53
Summe		555.858	16,51
Umgekehrte Pensionsgeschäfte			
BRC		(217)	(0,01)
Dynamic Multi-Asset Fund			
Total Return Swaps			
BPS	€	(2.830)	(0,07)
Pensionsgeschäfte			
BPS		73.200	1,72
FICC		16.166	0,38
IND		240.200	5,64
Summe		329.566	7,74
Emerging Local Bond Fund			
Umgekehrte Pensionsgeschäfte			
BRC	$	(73.428)	(2,63)
JML		(6.864)	(0,25)
MBC		(45.840)	(1,65)
SCX		(23.881)	(0,86)
Summe		(150.013)	(5,39)

Fonds		30. Jun. 2023 Marktwert (000S)	% des Nettovermögens
Emerging Local Bond ESG Fund			
Umgekehrte Pensionsgeschäfte			
BPS	$	(110)	(1,43)
Emerging Markets Bond Fund			
Umgekehrte Pensionsgeschäfte			
BPS	$	(30.379)	(0,90)
BRC		(20.783)	(0,62)
MBC		(3.301)	(0,09)
NOM		(449)	(0,01)
Summe		(54.912)	(1,62)
Emerging Markets Bond ESG Fund			
Pensionsgeschäfte			
BPS	$	84.900	3,59
FICC		6.040	0,26
Summe		90.940	3,85
Umgekehrte Pensionsgeschäfte			
BOS		(701)	(0,03)
BPS		(21.717)	(0,92)
BRC		(793)	(0,03)
MYI		(5.062)	(0,21)
NOM		(7.099)	(0,30)
SCX		(1.589)	(0,07)
Summe		(36.961)	(1,56)
Emerging Markets Corporate Bond Fund			
Pensionsgeschäfte			
FICC	$	3.949	2,47
PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund			
Pensionsgeschäfte			
SSB	$	939	0,41
Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund			
Pensionsgeschäfte			
SSB	$	150	0,75
PIMCO ESG Income Fund			
Pensionsgeschäfte			
BPS	$	31.800	12,49
Euro Bond Fund			
Pensionsgeschäfte			
COM	€	101.800	5,81
FICC		2.444	0,14
Summe		104.244	5,95
Euro Credit Fund			
Pensionsgeschäfte			
COM	€	27.600	4,53
FICC		977	0,16
Summe		28.577	4,69
Umgekehrte Pensionsgeschäfte			
MYI		(549)	(0,09)
Euro Income Bond Fund			
Pensionsgeschäfte			
COM	€	122.400	9,70
FICC		274	0,02
Summe		122.674	9,72
Umgekehrte Pensionsgeschäfte			
MYI		(8.856)	(0,70)
Euro Long Average Duration Fund			
Pensionsgeschäfte			
COM	€	6.700	1,49
FICC		633	0,14
Summe		7.333	1,63
Euro Short-Term Fund			
Pensionsgeschäfte			
COM	€	9.400	4,41
FICC		131	0,06
Summe		9.531	4,47

Fonds		30. Jun. 2023 Marktwert (000S)	% des Nettovermögens
PIMCO European High Yield Bond Fund			
Pensionsgeschäfte			
BPS	€	3.200	1,42
Umgekehrte Pensionsgeschäfte			
MYI		(837)	(0,37)
PIMCO European Short-Term Opportunities Fund			
Pensionsgeschäfte			
FICC	€	295	0,20
Global Advantage Fund			
Pensionsgeschäfte			
FICC	$	2.347	0,57
Global Bond Fund			
Pensionsgeschäfte			
BPS	$	127.200	1,01
BRC		593.900	4,71
Summe		721.100	5,72
Umgekehrte Pensionsgeschäfte			
MBC		(1.895)	(0,02)
Global Bond ESG Fund			
Pensionsgeschäfte			
BPS	$	204.500	6,12
FICC		1.785	0,05
Summe		206.285	6,17
Global Bond Ex-US Fund			
Total Return Swaps			
BOA	$	(18)	0,00
BPS		(146)	(0,02)
MYC		0	0,00
Summe		(164)	(0,02)
Pensionsgeschäfte			
FICC		1.874	0,26
PIMCO Global Core Asset Allocation Fund			
Total Return Swaps			
BOA	$	(970)	(0,14)
BPS		(208)	(0,03)
JPM		(989)	(0,15)
MBC		1.212	0,18
MYI		(53)	(0,01)
SOG		(650)	(0,10)
Summe		(1.658)	(0,25)
Pensionsgeschäfte			
FICC		18.513	2,77
Global High Yield Bond Fund			
Pensionsgeschäfte			
FICC	$	3.895	0,13
Umgekehrte Pensionsgeschäfte			
BRC		(1.913)	(0,06)
JML		(6.473)	(0,22)
MYI		(3.599)	(0,11)
Summe		(11.985)	(0,39)
Global Investment Grade Credit Fund			
Pensionsgeschäfte			
BRC	$	472.200	4,50
FICC		79.332	0,75
SAL		8.000	0,08
Summe		559.532	5,33
Global Investment Grade Credit ESG Fund			
Pensionsgeschäfte			
SSB	$	2.319	0,13
Umgekehrte Pensionsgeschäfte			
BOS		(151.412)	(8,32)
Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte			
BPG		(23.851)	(1,31)
MSC		(6.982)	(0,38)

Fonds		30. Jun. 2023 Marktwert (000S)	% des Nettovermögens
Summe		(30.833)	(1,69)
Global Low Duration Real Return Fund			
Pensionsgeschäfte			
FICC	$	7.529	0,60
Umgekehrte Pensionsgeschäfte			
BOS		(408.892)	(32,63)
Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte			
TDM		(9.212)	(0,74)
Global Real Return Fund			
Pensionsgeschäfte			
FICC	$	2.272	0,09
Umgekehrte Pensionsgeschäfte			
BOS		(10.867)	(0,43)
BSN		(548.666)	(21,85)
CIB		(19.218)	(0,77)
GRE		(34.244)	(1,37)
NOM		(178.315)	(7,10)
Summe		(791.310)	(31,52)
Income Fund			
Pensionsgeschäfte			
BPS	$	877.858	1,37
BRC		417.900	0,65
FICC		122.098	0,19
MBC		558.100	0,86
NXN		105.100	0,16
SOG		9.545	0,01
Summe		2.090.601	3,24
Umgekehrte Pensionsgeschäfte			
BRC		(5.159)	(0,01)
MBC		(3.161)	0,00
Summe		(8.320)	(0,01)
Inflation Multi-Asset Fund			
Total Return Swaps			
BPS	$	246	0,07
JPM		(78)	(0,02)
MAC		(421)	(0,13)
SOG		73	0,02
Summe		(180)	(0,06)
Pensionsgeschäfte			
BOS		3.300	1,02
SSB		801	0,25
Summe		4.101	1,27
Low Average Duration Fund			
Umgekehrte Pensionsgeschäfte			
BOS	$	(169.814)	(19,16)
GRE		(52.171)	(5,89)
Summe		(221.985)	(25,05)
Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte			
BPG		(19.674)	(2,22)
Low Duration Global Investment Grade Credit Fund			
Pensionsgeschäfte			
FICC	$	563	0,07
Low Duration Income Fund			
Pensionsgeschäfte			
BPS	$	322.600	22,16
FICC		3.892	0,27
Summe		326.492	22,43
Low Duration Opportunities Fund			
Pensionsgeschäfte			
BPS	$	92.300	8,23
FICC		2.587	0,23
Summe		94.887	8,46

	30. Jun. 2023	
	Marktwert (000S)	% des Nettovermögens
PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund		
Total Return Swaps		
BOA	$ 756	0,79
BPS	69	0,07
CBK	(9)	(0,01)
FAR	76	0,08
JPM	9	0,01
MYI	573	0,58
Summe	1.474	1,52
Pensionsgeschäfte		
SSB	840	0,87
Mortgage Opportunities Fund		
Pensionsgeschäfte		
FICC	$ 4.008	0,65
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
BOS	(6.770)	(1,09)
CIB	(338.422)	(54,56)
Summe	(345.192)	(55,65)
StocksPLUS™ Fund		
Total Return Swaps		
CBK	$ 375	0,02
FAR	6.677	0,37
JPM	11.224	0,62
RBC	26.283	1,46
UBS	1.397	0,08
Summe	45.956	2,55
Pensionsgeschäfte		
BPS	174.000	9,64
BRC	36.600	2,03
DEU	100	0,01
FICC	10.413	0,58
GSC	130.000	7,21
MFK	150.000	8,31
RVM	150.000	8,31
Summe	651.113	36,09
PIMCO StocksPLUS™ AR Fund		
Total Return Swaps		
BRC	$ 62	0,53
CBK	94	0,82
FAR	133	1,15
RBC	315	2,73
Summe	604	5,23
Pensionsgeschäfte		
BPS	3.900	33,78
SSB	118	1,02
Summe	4.018	34,80
Strategic Income Fund		
Pensionsgeschäfte		
FICC	$ 2.001	0,43
Total Return Bond Fund		
Pensionsgeschäfte		
FICC	$ 1.321	0,03
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
BRC	(8.309)	(0,19)
MYI	(1.098)	(0,03)
Summe	(9.407)	(0,22)
Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte		
BPG	(7.982)	(0,18)
PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund		
Total Return Swaps		
MEI	$ (232)	(0,08)
Pensionsgeschäfte		
BPS	2.500	0,83
SSB	2.083	0,69
Summe	4.583	1,52

	30. Jun. 2023	
	Marktwert (000S)	% des Nettovermögens
UK Corporate Bond Fund		
Pensionsgeschäfte		
BRC	£ 13.000	3,88
FICC	102	0,03
Summe	13.102	3,91
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
SCX	(25.054)	(7,48)
UK Long Term Corporate Bond Fund		
Pensionsgeschäfte		
FICC	£ 322	0,11
SCX	1.600	0,54
Summe	1.922	0,65
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
SCX	(2.915)	(0,98)
US High Yield Bond Fund		
Pensionsgeschäfte		
FICC	$ 10.034	0,51
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
BOS	(3.139)	(0,16)
BRC	(1.740)	(0,09)
MYI	(1.060)	(0,05)
RDR	(3.547)	(0,18)
Summe	(9.486)	(0,48)
US Investment Grade Corporate Bond Fund		
Pensionsgeschäfte		
BPS	$ 22.300	5,01
FICC	2.968	0,67
Summe	25.268	5,68
US Short-Term Fund		
Pensionsgeschäfte		
BPS	$ 225.700	10,93
FICC	2.237	0,11
Summe	227.937	11,04

Zum 31. Dezember 2022 hielten die Fonds Total Return Swaps und die folgenden Arten von SFTs:

- Pensionsgeschäfte
- Umgekehrte Pensionsgeschäfte
- Sale-Buyback-Geschäfte

Der Marktwert von Vermögenswerten/(Verbindlichkeiten) über alle SFTs und Total Return Swaps hinweg, jeweils gruppiert nach SFT-Art(en), und die zehn größten Kontrahenten gestalteten sich zum 31. Dezember 2022 wie nachfolgend angegeben (wenn weniger als zehn Kontrahenten verwendet werden, sind alle Kontrahenten aufgeführt).

	31. Dez. 2022	
Fonds	Marktwert (000S)	% des Nettovermögen
PIMCO Asia High Yield Bond Fund		
Pensionsgeschäfte		
SSB	$ 20.572	0,69
Asia Strategic Interest Bond Fund		
Pensionsgeschäfte		
SSB	$ 820	0,26
PIMCO Capital Securities Fund		
Pensionsgeschäfte		
FICC	$ 10.172	0,18
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
BPS	(71.348)	(1,25)
BRC	(4.860)	(0,08)
BYR	(59.977)	(1,05)
FBF	(2.857)	(0,05)
IND	(171.111)	(2,98)
JML	(135.138)	(2,36)
SCX	(133.184)	(2,34)
Summe	(578.475)	(10,11)

Fonds		31. Dez. 2022 Marktwert (000S)	% des Nettovermögen
PIMCO Climate Bond Fund			
Pensionsgeschäfte			
TDM	$	36.800	12,57
Commodity Real Return Fund			
Total Return Swaps			
BPS	$	(2.955)	(0,21)
CBK		(2.457)	(0,18)
CIB		(334)	(0,02)
FBF		(181)	(0,01)
GST		(3.476)	(0,25)
JPM		(345)	(0,03)
MAC		1.137	0,08
MEI		(251)	(0,02)
SOG		(497)	(0,04)
Summe		(9.359)	(0,68)
Pensionsgeschäfte			
FICC		613	0,04
IND		58.500	4,28
Summe		59.113	4,32
Umgekehrte Pensionsgeschäfte			
BOS		(485)	(0,04)
CIB		(331.976)	(24,23)
GRE		(67.687)	(4,94)
RCY		(25.154)	(1,84)
Summe		(425.302)	(31,05)
Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte			
BOS		(17.959)	(1,31)
PIMCO Credit Opportunities Bond Fund			
Total Return Swaps			
BPS	$	(160)	(0,16)
Pensionsgeschäfte			
BPS		6.300	6,48
FICC		610	0,63
Summe		6.910	7,11
Diversified Income Fund			
Pensionsgeschäfte			
BOS	$	500.000	5,71
BRC		568.200	6,49
CIB		580.100	6,63
FICC		41.323	0,47
MBC		56.700	0,65
Summe		1.746.323	19,95
Umgekehrte Pensionsgeschäfte			
BRC		(4.363)	(0,05)
JML		(2.283)	(0,03)
Summe		(6.646)	(0,08)
Diversified Income Duration Hedged Fund			
Pensionsgeschäfte			
FICC	$	102.832	18,21
Dynamic Bond Fund			
Pensionsgeschäfte			
BRC	$	1.055.700	30,31
FICC		2.892	0,08
SAL		87.100	2,50
Summe		1.145.692	32,89
Umgekehrte Pensionsgeschäfte			
DBL		(2.164)	(0,06)
Dynamic Multi-Asset Fund			
Total Return Swaps			
BPS	€	440	0,01
JPM		146	0,00
MEI		80	0,00
Summe		666	0,01

Fonds		31. Dez. 2022 Marktwert (000S)	% des Nettovermögen
Dynamic Multi-Asset Fund (Fortsetzung)			
Pensionsgeschäfte			
BPS	€	22.818	0,45
CDI		100.000	1,96
FICC		1.786	0,03
Summe		124.604	2,44
Umgekehrte Pensionsgeschäfte			
BPS		(17.828)	(0,35)
Emerging Local Bond Fund			
Umgekehrte Pensionsgeschäfte			
BPS	$	(39.132)	(2,04)
BRC		(46.181)	(2,41)
Summe		(85.313)	(4,45)
Emerging Markets Bond Fund			
Pensionsgeschäfte			
FICC	$	9.160	0,28
Umgekehrte Pensionsgeschäfte			
BPS		(36.659)	(1,11)
BRC		(16.023)	(0,48)
MBC		(1.622)	(0,05)
MEI		(21.052)	(0,64)
Summe		(75.356)	(2,28)
Emerging Markets Bond ESG Fund			
Pensionsgeschäfte			
FICC	$	9.261	0,37
NOM		35.400	1,42
Summe		44.661	1,79
Umgekehrte Pensionsgeschäfte			
BPS		(21.023)	(0,84)
BRC		(6.168)	(0,25)
MEI		(4.460)	(0,18)
NOM		(7.189)	(0,29)
Summe		(38.840)	(1,56)
Emerging Markets Corporate Bond Fund			
Pensionsgeschäfte			
BPS	$	6.100	3,61
FICC		2.286	1,35
Summe		8.386	4,96
PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund			
Pensionsgeschäfte			
SSB	$	706	0,35
Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund			
Pensionsgeschäfte			
SAL	$	2.500	11,95
SSB		266	1,27
Summe		2.766	13,22
PIMCO ESG Income Fund			
Pensionsgeschäfte			
BPS	$	44.400	18,66
Euro Bond Fund			
Pensionsgeschäfte			
BPS	€	10.900	0,57
FICC		615	0,03
Summe		11.515	0,60
Euro Credit Fund			
Pensionsgeschäfte			
BPS	€	7.400	1,21
FICC		921	0,15
IND		36.300	5,95
Summe		44.621	7,31
Euro Income Bond Fund			
Pensionsgeschäfte			
BPS	€	16.600	1,23
COM		100.000	7,38
FICC		3.858	0,29
Summe		120.458	8,90

Fonds	31. Dez. 2022 Marktwert (000S)	% des Nettovermögen
Euro Long Average Duration Fund		
Pensionsgeschäfte		
BPS	€ 1.500	1,36
Euro Short-Term Fund		
Pensionsgeschäfte		
BPS	€ 14.100	3,99
PIMCO European High Yield Bond Fund		
Pensionsgeschäfte		
BPS	€ 3.700	2,12
PIMCO European Short-Term Opportunities Fund		
Pensionsgeschäfte		
BPS	€ 4.400	2,08
Global Advantage Fund		
Pensionsgeschäfte		
FICC	$ 1.408	0,34
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
MEI	(1.504)	(0,37)
Global Bond Fund		
Pensionsgeschäfte		
BPS	$ 660.000	5,77
CIB	562.700	4,93
FICC	124.270	1,09
Summe	1.346.970	11,79
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
FBF	(1.682)	(0,01)
Global Bond ESG Fund		
Pensionsgeschäfte		
BPS	$ 275.900	8,88
BRC	313.900	10,11
FICC	568.047	18,29
Summe	1.157.847	37,28
Global Bond Ex-US Fund		
Total Return Swaps		
BOA	$ 182	0,03
BPS	315	0,04
MYC	21	0,00
Summe	518	0,07
Pensionsgeschäfte		
FICC	1.625	0,23
PIMCO Global Core Asset Allocation Fund		
Total Return Swaps		
BOA	$ 384	0,05
BPS	62	0,01
BRC	(49)	(0,01)
GST	(2)	0,00
JPM	192	0,03
MBC	(33)	0,00
MEI	7	0,00
MYI	(122)	(0,03)
SOG	118	0,02
Summe	557	0,07
Pensionsgeschäfte		
BPS	7.300	0,97
FICC	11.236	1,50
Summe	18.536	2,47
Global High Yield Bond Fund		
Pensionsgeschäfte		
FICC	$ 7.812	0,25
NOM	3.600	0,12
Summe	11.412	0,37
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
BRC	(5.516)	(0,18)
FBF	(2.419)	(0,08)
JML	(2.462)	(0,08)
Summe	(10.397)	(0,34)

Fonds	31. Dez. 2022 Marktwert (000S)	% des Nettovermögen
Global Investment Grade Credit Fund		
Pensionsgeschäfte		
DEU	$ 30.800	0,29
FICC	29.223	0,28
SAL	15.400	0,15
Summe	75.423	0,72
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
BRC	(2.721)	(0,03)
JML	(1.433)	(0,01)
Summe	(4.154)	(0,04)
Global Investment Grade Credit ESG Fund		
Pensionsgeschäfte		
SSB	$ 15.240	1,11
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
BOS	(75.130)	(5,48)
BRC	(798)	(0,06)
Summe	(75.928)	(5,54)
Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte		
BPG	(75.242)	(5,49)
MSC	(684)	(0,05)
Summe	(75.926)	(5,54)
Global Low Duration Real Return Fund		
Pensionsgeschäfte		
FICC	$ 1.053	0,08
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
CIB	(190.632)	(13,97)
DEU	(71.081)	(5,21)
Summe	(261.713)	(19,18)
Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte		
BRC	(69.575)	(5,10)
TDM	(10.024)	(0,73)
Summe	(79.599)	(5,83)
Global Real Return Fund		
Pensionsgeschäfte		
FICC	$ 2.245	0,09
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
BOS	(14.838)	(0,58)
BRC	(3.159)	(0,12)
BSN	(554.549)	(21,56)
CIB	(171.691)	(6,68)
GRE	(51.915)	(2,02)
Summe	(796.152)	(30,96)
Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte		
BOS	(9.519)	(0,37)
Income Fund		
Total Return Swaps		
BOA	$ 80	0,00
GST	(735)	0,00
Summe	(655)	0,00
Pensionsgeschäfte		
BOS	500.000	0,86
DEU	116.100	0,20
FICC	2.037.659	3,51
MBC	644.900	1,11
SGY	113.800	0,20
SOG	9.239	0,02
Summe	3.421.698	5,90
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
BRC	(5.155)	(0,01)
DBL	(10.712)	(0,02)
Summe	(15.867)	(0,03)
Inflation Multi-Asset Fund		
Total Return Swaps		
BPS	$ (373)	(0,09)
BRC	(21)	(0,01)
CBK	(76)	(0,02)
GST	(118)	(0,03)

Fonds	31. Dez. 2022 Marktwert (000S)	% des Nettovermögen
Inflation Multi-Asset Fund (Fortsetzung)		
JPM	$ 17	0,00
MAC	192	0,05
MYI	(362)	(0,09)
SOG	(48)	(0,01)
Summe	(789)	(0,20)
Pensionsgeschäfte		
GSC	37.700	9,34
SSB	3.020	0,76
Summe	40.720	10,10
Low Average Duration Fund		
Pensionsgeschäfte		
FICC	$ 956	0,09
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
BOS	(128.895)	(12,01)
GRE	(15.962)	(1,49)
Summe	(144.857)	(13,50)
Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte		
CSN	(4.077)	(0,38)
Low Duration Global Investment Grade Credit Fund		
Pensionsgeschäfte		
FICC	$ 1.604	0,24
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
BOS	(2.415)	(0,37)
BRC	(607)	(0,09)
GRE	(9.754)	(1,49)
Summe	(12.776)	(1,95)
Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte		
BPG	(1.409)	(0,22)
Low Duration Income Fund		
Total Return Swaps		
GST	$ (2)	0,00
Pensionsgeschäfte		
FICC	5.431	0,50
MBC	93.400	8,61
Summe	98.831	9,11
Low Duration Opportunities Fund		
Pensionsgeschäfte		
FICC	$ 118.800	8,83
PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund		
Total Return Swaps		
BOA	$ (130)	(0,10)
CBK	(8)	(0,01)
FAR	(18)	(0,01)
JPM	(1)	0,00
MYI	16	0,01
Summe	(141)	(0,11)
Pensionsgeschäfte		
SSB	811	0,68
Mortgage Opportunities Fund		
Pensionsgeschäfte		
BPS	$ 13.700	1,61
FICC	3.618	0,43
Summe	17.318	2,04
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
CIB	(264.111)	(31,10)
JPS	(724)	(0,09)
RCY	(23.192)	(2,73)
SCX	(28.466)	(3,35)
Summe	(316.493)	(37,27)
StocksPLUS™ Fund		
Total Return Swaps		
FAR	$ (1.148)	(0,11)
MBC	(120)	(0,01)
RBC	(1.063)	(0,11)
StocksPLUS™ Fund (Fortsetzung)		
UBS	$ (35)	(0,01)
Summe	(2.366)	(0,24)
Pensionsgeschäfte		
BOS	20.300	2,01
FICC	14.743	1,46
NOM	60.000	5,95
SGY	24.500	2,43
TOR	36.902	3,67
Summe	156.445	15,52
PIMCO StocksPLUS™ AR Fund		
Total Return Swaps		
BRC	$ (4)	(0,04)
FAR	(16)	(0,16)
RBC	(17)	(0,19)
Summe	(37)	(0,39)
Pensionsgeschäfte		
BPS	1.200	12,59
SSB	174	1,83
Summe	1.374	14,42
Strategic Income Fund		
Total Return Swaps		
GST	$ (4)	0,00
Pensionsgeschäfte		
FICC	781	0,15
Total Return Bond Fund		
Pensionsgeschäfte		
BOS	$ 26.100	0,63
FICC	144.795	3,49
Summe	170.895	4,12
Umgekehrte Pensionsgeschäfte		
BRC	(1.745)	(0,04)
Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte		
BPG	(76.809)	(1,85)
PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund		
Total Return Swaps		
MEI	$ (165)	(0,04)
Pensionsgeschäfte		
BPS	22.700	5,21
SSB	4.752	1,09
Summe	27.452	6,30
UK Corporate Bond Fund		
Pensionsgeschäfte		
FICC	£ 177	0,05
UK Long Term Corporate Bond Fund		
Pensionsgeschäfte		
FICC	£ 269	0,08
US High Yield Bond Fund		
Pensionsgeschäfte		
FICC	$ 9.269	0,47
US Investment Grade Corporate Bond Fund		
Pensionsgeschäfte		
BOS	$ 12.800	3,30
FICC	2.583	0,66
Summe	15.383	3,96
Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte		
BPG	(38.655)	(9,95)
US Short-Term Fund		
Pensionsgeschäfte		
FICC	$ 154.472	6,69

(b) Sicherheiten

(i) Verwahrung erhaltener Sicherheiten:

Die zum 30. Juni 2023 und zum 31. Dezember 2022 erhaltenen Sicherheiten wurden im globalen Depotbanknetz der State Street Bank and Trust als oberste Muttergesellschaft der Verwahrstelle gehalten.

(ii) Konzentrationsdaten:

Die zehn größten Emittenten von Wertpapieren, die als Sicherheiten über sämtliche SFTs hinweg erhalten wurden, gestalteten sich zum 30. Juni 2023 wie folgt. Wenn weniger als zehn Emittenten vorliegen, sind alle Emittenten nachfolgend aufgeführt:

	Zum 30. Jun. 2023		
Fonds	Sicherheitenemittent		Marktwert (000S)
PIMCO Asia High Yield Bond Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	$	7.156
Asia Strategic Interest Bond Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika		354
PIMCO Capital Securities Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika		25.876
PIMCO Climate Bond Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika		34.995
Commodity Real Return Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika		2.442
PIMCO Credit Opportunities Bond Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika		13.433
Diversified Income Fund	Ginnie Mae		100.088
	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika		1.165.706
Diversified Income Duration Hedged Fund	Ginnie Mae		6.004
	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika		104.469
Diversified Income ESG Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika		7.643
Dynamic Bond Fund	Fannie Mae		395.977
	Ginnie Mae		83.801
	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika		90.822
Dynamic Multi-Asset Fund	Agence Francaise de Developpement	€	6.042
	BNG Bank NV		2.220
	Bpifrance		798
	Caisse d'Amortissement de la Dette Sociale		1.508
	Rat der Europäischen Entwicklungsbank		2.300
	Europäische Union		106.469
	Regierung von Frankreich		28.465
	Germany Government		2.043
	Kreditanstalt für Wiederaufbau		32.466
	La Poste S.A.		1.143
	Landwirtschaftliche Rentenbank		1.237
	Regierung von Luxemburg		50.663
	Nederlandse Waterschapsbank NV		1.634
	NRW Bank		600
	SFIL S.A.		174
	Societe Nationale SNCF S.A.		73.831
	Land Berlin		3.312
	State of Lower Saxony		197
	UNEDIC		4.648
	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika		16.489
Emerging Markets Bond Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	$	27
Emerging Markets Bond ESG Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika		92.751
Emerging Markets Corporate Bond Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika		4.028
PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika		958
Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika		153
PIMCO ESG Income Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika		32.515
Euro Bond Fund	Land Nordrhein-Westfalen	€	100.000
	Land Saarland		8.561
	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika		2.493

	Zum 30. Jun. 2023		
Fonds	Sicherheitenemittent		Marktwert (000S)
Euro Credit Fund	Land Nordrhein-Westfalen	€	28.356
	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika		997
Euro Income Bond Fund	State of Brandenburg		100.000
	Land Nordrhein-Westfalen		32.863
	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika		280
Euro Long Average Duration Fund	Land Berlin		6.030
	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika		646
Euro Short-Term Fund	State of Brandenburg		9.724
	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika		134
PIMCO European High Yield Bond Fund	Europäische Union		3.250
PIMCO European Short-Term Opportunities Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika		301
Global Advantage Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	$	2.394
Global Bond Fund	Ginnie Mae		102
	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika		735.683
Global Bond ESG Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika		210.484
Global Bond Ex-US Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika		1.911
PIMCO Global Core Asset Allocation Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika		18.883
Global High Yield Bond Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika		3.973
Global Investment Grade Credit Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika		571.059
Global Investment Grade Credit ESG Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika		2.365
Global Low Duration Real Return Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika		7.680
Global Real Return Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika		2.317
Income Fund	American International Group, Inc.		3.115
	Amgen, Inc.		1.966
	Barclays PLC		3.300
	Canada Government International Bond		225.563
	Morgan Stanley		1.791
	Province of Quebec		161.448
	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika		1.744.640
Inflation Multi-Asset Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika		4.206
Low Duration Global Investment Grade Credit Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika		574
Low Duration Income Fund	Ginnie Mae		48.032
	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika		285.568
Low Duration Opportunities Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika		96.812
PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika		857
Mortgage Opportunities Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika		4.088
StocksPLUS™ Fund	Fannie Mae		134.655
	Ginnie Mae		179.208
	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika		354.160
PIMCO StocksPLUS™ AR Fund	Ginnie Mae		1.863
	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika		2.265
Strategic Income Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika		2.041
Total Return Bond Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika		1.347
PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika		4.678
UK Corporate Bond Fund	Regierung des Vereinigten Königreichs	£	13.263
	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika		104
UK Long Term Corporate Bond Fund	Regierung des Vereinigten Königreichs		1.644
	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika		329
US High Yield Bond Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	$	10.808
US Investment Grade Corporate Bond Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika		25.782
US Short-Term Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika		232.988

Die zehn größten Emittenten von Wertpapieren, die als Sicherheiten über sämtliche SFTs hinweg erhalten wurden, gestalteten sich zum 31. Dezember 2022 wie folgt. Wenn weniger als zehn Emittenten vorliegen, sind alle Emittenten nachfolgend aufgeführt:

	Zum 31. Dez. 2022	
Fonds	**Sicherheitenemittent**	**Marktwert (000S)**
PIMCO Asia High Yield Bond Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	$ 20.983
Asia Strategic Interest Bond Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	836
PIMCO Capital Securities Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	10.375
PIMCO Climate Bond Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	38.412
Commodity Real Return Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	61.286
PIMCO Credit Opportunities Bond Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	7.060
Diversified Income Fund	Freddie Mac	139.541
	Ginnie Mae	450.224
	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	1.205.939
Diversified Income Duration Hedged Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	104.889
Dynamic Bond Fund	Freddie Mac	139.541
	Ginnie Mae	413.154
	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	621.400
Dynamic Multi-Asset Fund	Caisse d'Amortissement de la Dette Sociale	€ 100.270
	Europäische Union	18.150
	Kreditanstalt für Wiederaufbau	161
	Landwirtschaftliche Rentenbank	4.907
	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	1.822
Emerging Markets Bond Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	$ 9.343
Emerging Markets Bond ESG Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	45.570
Emerging Markets Corporate Bond Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	8.567
PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	720
Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	2.820
PIMCO ESG Income Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	45.259
Euro Bond Fund	BNG Bank NV	€ 11.063
	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	627
Euro Credit Fund	BNG Bank NV	2.776
	Bpifrance SACA	483
	Caisse d'Amortissement de la Dette Sociale	568
	Europäische Union	25.098
	Kreditanstalt für Wiederaufbau	4.431
	Landwirtschaftliche Rentenbank	8.536
	Land Nordrhein-Westfalen	837
	UNEDIC	1.626
	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	940

	Zum 31. Dez. 2022	
Fonds	**Sicherheitenemittent**	**Marktwert (000S)**
Euro Income Bond Fund	BNG Bank NV	€ 16.819
	Land Berlin	102.209
	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	3.935
Euro Long Average Duration Fund	Kreditanstalt für Wiederaufbau	1.517
Euro Short-Term Fund	BNG Bank NV	14.286
PIMCO European High Yield Bond Fund	Kreditanstalt für Wiederaufbau	3.743
PIMCO European Short-Term Opportunities Fund	Kreditanstalt für Wiederaufbau	4.454
Global Advantage Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	$ 1.436
Global Bond Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	1.378.007
Global Bond ESG Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	1.181.854
Global Bond Ex-US Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	1.658
PIMCO Global Core Asset Allocation Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	18.879
Global High Yield Bond Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	11.642
Global Investment Grade Credit Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	76.925
Global Investment Grade Credit ESG Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	15.545
Global Low Duration Real Return Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	1.074
Global Real Return Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	2.391
Income Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	3.498.550
Inflation Multi-Asset Fund	Freddie Mac	38.846
	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	3.080
Low Average Duration Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	975
Low Duration Global Investment Grade Credit Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	1.636
Low Duration Income Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	101.947
Low Duration Opportunities Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	121.176
PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	827
StocksPLUS™ Fund	Regierung von Kanada	36.902
	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	122.051
PIMCO StocksPLUS™ AR Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	1.405
Strategic Income Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	797
Total Return Bond Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	174.491
PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	28.016
UK Corporate Bond Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	£ 181
UK Long Term Corporate Bond Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	274
US High Yield Bond Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	$ 9.454
US Investment Grade Corporate Bond Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	15.768
US Short-Term Fund	Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika	157.561

(iii) Aggregierte Transaktionsdaten:

Die aggregierten Transaktionsdaten für Sicherheitenpositionen (einschließlich von Barmitteln), die über sämtliche SFTs und Total Return Swaps hinweg erhalten wurden, gestalteten sich zum 30. Juni 2023 wie folgt:

Fonds	Wertpapierart	Beschreibung der Sicherheiten	Art der Sicherheiten	Markt-wert (000S)	Qualität	Fälligkeits-profil der Sicherheiten	Währung der Sicherheiten	Gründungs-land des Kontrahenten	Abrechnung und Clearing
PIMCO Asia High Yield Bond Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Notes	Treasury	$ 7.156	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	USA	FED, Bilateral
Asia Strategic Interest Bond Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Notes	Treasury	354	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
PIMCO Capital Securities Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Bonds	Treasury	25.876	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
	Umgekehrte Pensionsgeschäfte	Barsicherheiten	Zahlungsmittel	790	k. A.	k. A.	USD	Frankreich	FED, Bilateral
		Barsicherheiten	Zahlungsmittel	7.750	k. A.	k. A.	USD	Großbritannien	FED, Bilateral

Fonds	Wertpapierart	Beschreibung der Sicherheiten	Art der Sicherheiten	Markt-wert (000$)	Qualität	Fälligkeits-profil der Sicherheiten	Währung der Sicherheiten	Gründungs-land des Kontrahenten	Abrechnung und Clearing
PIMCO Climate Bond Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Bonds	Treasury	$ 34.995	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
Commodity Real Return Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Notes	Treasury	2.442	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
PIMCO Credit Opportunities Bond Fund	Swap-Kontrakte	Barsicherheiten	Zahlungsmittel	260	k. A.	k. A.	USD	Frankreich	FED, Bilateral
	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Notes	Treasury	12.869	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Frankreich	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Notes	Treasury	564	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
Diversified Income Fund	Pensionsgeschäfte	Ginnie Mae	Mortgage Pass Thru	100.088	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Großbritannien	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Bonds	Treasury	353.153	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Großbritannien	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Inflation Protected Securities	Treasury	1.640	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Frankreich	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Notes	Treasury	255.041	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Frankreich	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Notes	Treasury	447.505	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Großbritannien	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Notes	Treasury	108.367	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
	Umgekehrte Pensionsgeschäfte	Barsicherheiten	Zahlungsmittel	288	k. A.	k. A.	USD	Großbritannien	FED, Bilateral
Diversified Income Duration Hedged Fund	Pensionsgeschäfte	Ginnie Mae	Mortgage Pass Thru	6.004	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Frankreich	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Bonds	Treasury	93.785	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Inflation Protected Securities	Treasury	102	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Frankreich	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Notes	Treasury	7.251	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Frankreich	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Notes	Treasury	3.331	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
Diversified Income ESG Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Notes	Treasury	7.643	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Großbritannien	FED, Bilateral
Dynamic Bond Fund	Pensionsgeschäfte	Fannie Mae	Mortgage Pass Thru	395.977	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Großbritannien	FED, Bilateral
		Ginnie Mae	Mortgage Pass Thru	83.801	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Großbritannien	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Notes	Treasury	90.822	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
Dynamic Multi-Asset Fund	Swap-Kontrakte	Barsicherheiten	Zahlungsmittel	€ 2.400	k. A.	k. A.	EUR	Frankreich	FED, Bilateral
	Pensionsgeschäfte	Agence Francaise de Developpement	Unternehmens anleihen	697	AA	3 Monate - 1 Jahr	EUR	Frankreich	FED, Bilateral
		Agence Francaise de Developpement	Unternehmens anleihen	4.653	AA	Mehr als 1 Jahr	EUR	Frankreich	FED, Bilateral
		Agence France Locale	Unternehmens anleihen	692	A-	Mehr als 1 Jahr	EUR	Frankreich	FED, Bilateral
		BNG Bank NV	Treasury	2.220	AAA	Mehr als 1 Jahr	EUR	Frankreich	FED, Bilateral
		Bpifrance Financement S.A.	Treasury	798	AA-	Mehr als 1 Jahr	EUR	Frankreich	FED, Bilateral
		Caisse d'Amortissement de la Dette Sociale	Treasury	497	AA-	3 Monate - 1 Jahr	EUR	Frankreich	FED, Bilateral
		Caisse d'Amortissement de la Dette Sociale	Treasury	1.011	AA-	Mehr als 1 Jahr	EUR	Frankreich	FED, Bilateral
		Rat der Europäischen Entwicklungsbank	Treasury	2.300	AA+	Mehr als 1 Jahr	EUR	Frankreich	FED, Bilateral
		Europäische Finanz-stabilisierungsfazilität	Treasury	13.142	AAA	Mehr als 1 Jahr	EUR	Frankreich	FED, Bilateral
		Europäische Finanz-stabilisierungsfazilität	Treasury	7.333	AAA	Unter 1 Monat	EUR	Frankreich	FED, Bilateral
		Europäische Investitionsbank	Treasury	29.499	AAA	Mehr als 1 Jahr	EUR	Frankreich	FED, Bilateral
		Europäischer Stabilitätsmechanismus	Treasury	3.895	AAA	1-3 Monate	EUR	Frankreich	FED, Bilateral
		Europäischer Stabilitätsmechanismus	Treasury	1.317	AAA	Mehr als 1 Jahr	EUR	Frankreich	FED, Bilateral
		Europäische Union	Treasury	30.747	AAA	Mehr als 1 Jahr	EUR	Frankreich	FED, Bilateral
		European Union Treasury Bills	Treasury	9.739	AAA	1-3 Monate	EUR	Frankreich	FED, Bilateral
		European Union Treasury Bills	Treasury	10.797	AAA	3 Monate - 1 Jahr	EUR	Frankreich	FED, Bilateral
		France Government International Bond	Treasury	26.399	AA	3 Monate - 1 Jahr	EUR	Frankreich	FED, Bilateral
		France Government International Bond	Treasury	2.066	AA	Mehr als 1 Jahr	EUR	Frankreich	FED, Bilateral
		Kreditanstalt für Wiederaufbau	Unternehmen-sanleihen	1.364	AAA	3 Monate - 1 Jahr	EUR	Frankreich	FED, Bilateral

Fonds	Wertpapierart	Beschreibung der Sicherheiten	Art der Sicherheiten	Markt-wert (000S)	Qualität	Fälligkeits-profil der Sicherheiten	Währung der Sicherheiten	Gründungs-land des Kontrahenten	Abrechnung und Clearing
		Kreditanstalt für Wiederaufbau	Unternehmen-sanleihen	€ 31.102	AAA	Mehr als 1 Jahr	EUR	Frankreich	FED, Bilateral
		La Poste S.A.	Unternehmen-sanleihen	1.143	A+	Mehr als 1 Jahr	EUR	Frankreich	FED, Bilateral
		Land Berlin	Treasury	3.312	AAA	Mehr als 1 Jahr	EUR	Frankreich	FED, Bilateral
		Landwirtschaftliche Rentenbank	Treasury	1.237	AAA	Mehr als 1 Jahr	EUR	Frankreich	FED, Bilateral
		Luxembourg Government International Bond	Treasury	50.663	AAA	Mehr als 1 Jahr	EUR	Frankreich	FED, Bilateral
		Nederlandse Waterschapsbank NV	Treasury	1.634	AAA	Mehr als 1 Jahr	EUR	Frankreich	FED, Bilateral
		NRW Bank	Unternehmen-sanleihen	600	AAA	Mehr als 1 Jahr	EUR	Frankreich	FED, Bilateral
		SFIL S.A.	Unternehmen-sanleihen	174	AA-	Mehr als 1 Jahr	EUR	Frankreich	FED, Bilateral
		Societe Nationale SNCF S.A.	Unternehmen-sanleihen	73.831	A+	Mehr als 1 Jahr	EUR	Frankreich	FED, Bilateral
		Land Niedersachsen	Treasury	197	AAA	Mehr als 1 Jahr	EUR	Frankreich	FED, Bilateral
		Land Nordrhein-Westfalen	Treasury	396	AAA	3 Monate - 1 Jahr	EUR	Frankreich	FED, Bilateral
		Land Nordrhein-Westfalen	Treasury	1.647	AAA	Mehr als 1 Jahr	EUR	Frankreich	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Notes	Treasury	16.489	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
		UNEDIC	Treasury	4.648	AA	Mehr als 1 Jahr	EUR	Frankreich	FED, Bilateral
Emerging Local Bond Fund	Umgekehrte Pensionsgeschäfte	Barsicherheiten	Zahlungsmittel	$ 285	k. A.	k. A.	USD	Großbritannien	FED, Bilateral
Emerging Markets Bond Fund	Umgekehrte Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Bonds	Treasury	27	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
Emerging Markets Bond ESG Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Notes	Treasury	86.590	AAA	3 Monate - 1 Jahr	USD	Frankreich	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Notes	Treasury	6.161	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
	Umgekehrte Pensionsgeschäfte	Barsicherheiten	Zahlungsmittel	280	k. A.	k. A.	USD	Frankreich	FED, Bilateral
Emerging Markets Corporate Bond Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Notes	Treasury	4.028	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Notes	Treasury	958	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Notes	Treasury	153	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
PIMCO ESG Income Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Inflation Protected Securities	Treasury	24.760	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Frankreich	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Notes	Treasury	7.755	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Frankreich	FED, Bilateral
Euro Bond Fund	Pensionsgeschäfte	Land Nordrhein-Westfalen	Treasury	€ 100.000	AAA	Mehr als 1 Jahr	EUR	Deutschland	FED, Bilateral
		Land Saarland	Treasury	8.561	AAA	Mehr als 1 Jahr	EUR	Deutschland	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Notes	Treasury	2.493	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
Euro Credit Fund	Pensionsgeschäfte	Land Nordrhein-Westfalen	Treasury	28.356	AAA	Mehr als 1 Jahr	EUR	Deutschland	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Notes	Treasury	997	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
Euro Income Bond Fund	Pensionsgeschäfte	State of Brandenburg	Treasury	100.000	AAA	Mehr als 1 Jahr	EUR	Deutschland	FED, Bilateral
		Land Nordrhein-Westfalen	Treasury	32.863	AAA	Mehr als 1 Jahr	EUR	Deutschland	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Notes	Treasury	280	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
	Umgekehrte Pensionsgeschäfte	Barsicherheiten	Zahlungsmittel	270	k. A.	k. A.	USD	Großbritannien	FED, Bilateral
Euro Long Average Duration Fund	Pensionsgeschäfte	Land Berlin	Treasury	6.030	AAA	Mehr als 1 Jahr	EUR	Deutschland	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Notes	Treasury	646	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
Euro Short-Term Fund	Pensionsgeschäfte	State of Brandenburg	Treasury	9.724	AAA	Mehr als 1 Jahr	EUR	Deutschland	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Notes	Treasury	134	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
PIMCO European High Yield Bond Fund	Pensionsgeschäfte	Europäische Union	Treasury	3.250	AAA	Mehr als 1 Jahr	EUR	Frankreich	FED, Bilateral
PIMCO European Short-Term Opportunities Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Notes	Treasury	301	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral

Fonds	Wertpapierart	Beschreibung der Sicherheiten	Art der Sicherheiten	Markt-wert (000S)	Qualität	Fälligkeits-profil der Sicherheiten	Währung der Sicherheiten	Gründungs-land des Kontrahenten	Abrechnung und Clearing
Global Advantage Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Notes	Treasury	$ 2.394	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
Global Bond Fund	Pensionsgeschäfte	Ginnie Mae	Mortgage Pass Thru	102	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Großbritannien	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Notes	Treasury	129.709	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Frankreich	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Notes	Treasury	605.974	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Großbritannien	FED, Bilateral
Global Bond ESG Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Inflation Protected Securities	Treasury	102	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Frankreich	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Notes	Treasury	208.561	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Frankreich	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Notes	Treasury	1.821	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
Global Bond Ex-US Fund	Swap-Kontrakte	Barsicherheiten	Zahlungsmittel	1.080	k. A.	k. A.	USD	Frankreich	FED, Bilateral
		Barsicherheiten	Zahlungsmittel	2.280	k. A.	k. A.	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Notes	Treasury	1.911	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
PIMCO Global Core Asset Allocation Fund	Swap-Kontrakte	Barsicherheiten	Zahlungsmittel	4.250	k. A.	k. A.	USD	Frankreich	FED, Bilateral
		Barsicherheiten	Zahlungsmittel	1.510	k. A.	k. A.	USD	Großbritannien	FED, Bilateral
		Barsicherheiten	Zahlungsmittel	410	k. A.	k. A.	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Notes	Treasury	18.883	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
Global High Yield Bond Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Notes	Treasury	3.973	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
Global Investment Grade Credit Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Notes	Treasury	481.979	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Großbritannien	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Notes	Treasury	89.080	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
Global Investment Grade Credit ESG Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Notes	Treasury	2.365	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
Global Low Duration Real Return Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Notes	Treasury	7.680	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
Global Real Return Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Notes	Treasury	2.317	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
Income Fund	Pensionsgeschäfte	American International Group, Inc.	Unternehmen-sanleihen	3.115	BBB+	Mehr als 1 Jahr	USD	Frankreich	FED, Bilateral
		Amgen, Inc.	Unternehmen-sanleihen	1.966	BBB+	3 Monate - 1 Jahr	USD	Frankreich	FED, Bilateral
		Barclays PLC	Unternehmen-sanleihen	3.300	A	Mehr als 1 Jahr	USD	Frankreich	FED, Bilateral
		Canada Government International Bond	Treasury	225.563	AA+	Mehr als 1 Jahr	CAD	Frankreich	FED, Bilateral
		Morgan Stanley	Unternehmen-sanleihen	1.791	A+	Mehr als 1 Jahr	USD	Frankreich	FED, Bilateral
		Province of Quebec	Treasury	161.448	AA-	Mehr als 1 Jahr	CAD	Frankreich	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Bills	Treasury	144.409	AAA	1-3 Monate	USD	Großbritannien	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Bonds	Treasury	49.959	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Großbritannien	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Bonds	Treasury	108.590	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Inflation Protected Securities	Treasury	60.417	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Großbritannien	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Notes	Treasury	510.165	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Frankreich	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Notes	Treasury	10.645	AAA	3 Monate - 1 Jahr	USD	Großbritannien	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Notes	Treasury	735.915	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Großbritannien	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Notes	Treasury	124.540	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
Inflation Multi-Asset Fund	Swap-Kontrakte	Barsicherheiten	Zahlungsmittel	1.340	k. A.	k. A.	USD	Frankreich	FED, Bilateral
	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Bonds	Treasury	3.389	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	USA	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Notes	Treasury	817	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
Low Duration Global Investment Grade Credit Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Notes	Treasury	574	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
Low Duration Income Fund	Pensionsgeschäfte	Ginnie Mae	Mortgage Pass Thru	48.032	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Frankreich	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Notes	Treasury	281.598	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Frankreich	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Notes	Treasury	3.970	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
Low Duration Opportunities Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Notes	Treasury	94.173	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Frankreich	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Notes	Treasury	2.639	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund	Swap-Kontrakte	Barsicherheiten	Zahlungsmittel	320	k. A.	k. A.	USD	Frankreich	FED, Bilateral
		Barsicherheiten	Zahlungsmittel	340	k. A.	k. A.	USD	Großbritannien	FED, Bilateral
		Barsicherheiten	Zahlungsmittel	820	k. A.	k. A.	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Notes	Treasury	857	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
Mortgage Opportunities Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Notes	Treasury	4.088	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral

Fonds	Wertpapierart	Beschreibung der Sicherheiten	Art der Sicherheiten		Markt-wert (000S)	Qualität	Fälligkeits-profil der Sicherheiten	Währung der Sicherheiten	Gründungs-land des Kontrahenten	Abrechnung und Clearing
StocksPLUS™ Fund	Swap-Kontrakte	Barsicherheiten	Zahlungsmittel	$	31.470	k. A.	k. A.	USD	USA	FED, Bilateral
	Pensionsgeschäfte	Fannie Mae	Mortgage Pass Thru		134.655	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
		Ginnie Mae	Mortgage Pass Thru		141.714	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Frankreich	FED, Bilateral
		Ginnie Mae	Mortgage Pass Thru		37.494	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Großbritannien	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Bonds	Treasury		153.753	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Inflation Protected Securities	Treasury		37.947	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Frankreich	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Notes	Treasury		151.839	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Cayman-Inseln	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Notes	Treasury		10.621	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
PIMCO StocksPLUS™ AR Fund	Swap-Kontrakte	Barsicherheiten	Zahlungsmittel		300	k. A.	k. A.	USD	Kanada	FED, Bilateral
		Barsicherheiten	Zahlungsmittel		80	k. A.	k. A.	USD	Großbritannien	FED, Bilateral
	Pensionsgeschäfte	Ginnie Mae	Mortgage Pass Thru		1.863	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Frankreich	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Notes	Treasury		2.145	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Frankreich	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Notes	Treasury		120	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
Strategic Income Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Notes	Treasury		2.041	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
Total Return Bond Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Notes	Treasury		1.347	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
	Umgekehrte Pensionsgeschäfte	Barsicherheiten	Zahlungsmittel		320	k. A.	k. A.	USD	Großbritannien	FED, Bilateral
PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Notes	Treasury		2.553	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Frankreich	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Notes	Treasury		2.125	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
UK Corporate Bond Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Notes	Treasury	£	104	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
		United Kingdom Gilt	Treasury		13.263	AA-	Mehr als 1 Jahr	GBP	Großbritannien	FED, Bilateral
UK Long Term Corporate Bond Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Notes	Treasury		329	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
		United Kingdom Gilt	Treasury		1.644	AA-	Mehr als 1 Jahr	GBP	Großbritannien	FED, Bilateral
US High Yield Bond Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Notes	Treasury	$	10.235	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
	Umgekehrte Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Bonds	Treasury		303	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Notes	Treasury		270	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
US Investment Grade Corporate Bond Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Notes	Treasury		22.755	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Frankreich	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Notes	Treasury		3.027	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
US Short-Term Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Inflation Protected Securities	Treasury		200.759	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Frankreich	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Notes	Treasury		29.947	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Frankreich	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Notes	Treasury		2.282	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral

Die aggregierten Transaktionsdaten für Sicherheitenpositionen (einschließlich von Barmitteln), die über sämtliche SFTs und Total Return Swaps hinweg erhalten wurden, gestalteten sich zum 31. Dezember 2022 wie folgt:

Fonds	Wertpapierart	Beschreibung der Sicherheiten	Art Sicherheiten		Markt-wert (000S)	Qualität	Fälligkeits-profil der Sicherheiten	Währung Sicherheiten	Gründungs-land des Kontrahenten	Abrechnungs- und Verrechnungssystem
PIMCO Asia High Yield Bond Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Notes	Treasury	$	20.983	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	USA	FED, Bilateral
Asia Strategic Interest Bond Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Notes	Treasury		836	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
PIMCO Capital Securities Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Bills	Treasury		10.375	AAA	3 Monate - 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
	Umgekehrte Pensionsgeschäfte	Barsicherheiten	Zahlungsmittel		3.516	k. A.	k. A.	USD	Kanada	FED, Bilateral
		Barsicherheiten	Zahlungsmittel		6.877	k. A.	k. A.	USD	Frankreich	FED, Bilateral
		Barsicherheiten	Zahlungsmittel		264	k. A.	k. A.	EUR	Großbritannien	FED, Bilateral
		Barsicherheiten	Zahlungsmittel		7.614	k. A.	k. A.	USD	Großbritannien	FED, Bilateral
PIMCO Climate Bond Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Bonds	Treasury		38.412	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
Commodity Real Return Fund	Swap-Kontrakte	Barsicherheiten	Zahlungsmittel		840	k. A.	k. A.	USD	Australien	FED, Bilateral
		Barsicherheiten	Zahlungsmittel		1.310	k. A.	k. A.	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Bills	Treasury		625	AAA	3 Monate - 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Bonds	Treasury		60.504	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Frankreich	FED, Bilateral
	Umgekehrte Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Bonds	Treasury		157	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral

Fonds	Wertpapierart	Beschreibung der Sicherheiten	Art Sicherheiten	Markt-wert (000S)	Qualität	Fälligkeits-profil der Sicherheiten	Währung Sicherheiten	Gründungs-land des Kontrahenten	Abrechnungs- und Verrechnungssystem
PIMCO Credit Opportunities Bond Fund	Pensionsgeschäfte			$					
		U.S. Treasury Bills	Treasury	62	AAA	3 Monate - 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Notes	Treasury	6.432	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Frankreich	FED, Bilateral
Diversified Income Fund	Pensionsgeschäfte	Freddie Mac	Mortgage Pass Thru	139.541	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Großbritannien	FED, Bilateral
		Ginnie Mae	Mortgage Pass Thru	450.224	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Großbritannien	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Bills	Treasury	58.078	AAA	3 Monate - 1 Jahr	USD	Großbritannien	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Bills	Treasury	42.150	AAA	3 Monate - 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Bonds	Treasury	513.516	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Inflation Protected Securities	Treasury	592.195	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
	Umgekehrte Pensionsgeschäfte	Barsicherheiten	Zahlungsmittel	27	k. A.	k. A.	USD	Großbritannien	FED, Bilateral
Diversified Income Duration Hedged Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Bills	Treasury	2.481	AAA	3 Monate - 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Notes	Treasury	102.408	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
Dynamic Bond Fund	Pensionsgeschäfte	Freddie Mac	Mortgage Pass Thru	139.541	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Großbritannien	FED, Bilateral
		Ginnie Mae	Mortgage Pass Thru	413.154	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Großbritannien	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Bills	Treasury	2.950	AAA	3 Monate - 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Bonds	Treasury	529.681	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Großbritannien	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Notes	Treasury	88.769	AAA	3 Monate - 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
Dynamic Multi-Asset Fund	Swap-Kontrakte			€					
		Barsicherheiten	Zahlungsmittel	10.200	k. A.	k. A.	EUR	Frankreich	FED, Bilateral
		Barsicherheiten	Zahlungsmittel	4.040	k. A.	k. A.	EUR	Großbritannien	FED, Bilateral
		Barsicherheiten	Zahlungsmittel	7.080	k. A.	k. A.	EUR	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
	Pensionsgeschäfte	Caisse d'Amortissement de la Dette Sociale	Treasury	100.270	AA	3 Monate - 1 Jahr	EUR	Frankreich	FED, Bilateral
		Europäischer Stabilitätsmechanismus	Treasury	18.150	AAA	1-3 Monate	EUR	Frankreich	FED, Bilateral
		Kreditanstalt für Wiederaufbau	Unternehmens anleihen	16	AAA	Mehr als 1 Jahr	EUR	Frankreich	FED, Bilateral
		Landwirtschaftliche Rentenbank	Unternehmens anleihen	4.907	AAA	Mehr als 1 Jahr	EUR	Frankreich	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Bills	Treasury	1.822	AAA	3 Monate - 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
Emerging Markets Bond Fund	Pensionsgeschäfte			$					
		U.S. Treasury Bills	Treasury	9.343	AAA	3 Monate - 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
	Umgekehrte Pensionsgeschäfte	Barsicherheiten	Zahlungsmittel	2.609	k. A.	k. A.	USD	Frankreich	FED, Bilateral
		Barsicherheiten	Zahlungsmittel	39	k. A.	k. A.	USD	Großbritannien	FED, Bilateral
Emerging Markets Bond ESG Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Bills	Treasury	9.446	AAA	3 Monate - 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Bonds	Treasury	36.124	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
	Umgekehrte Pensionsgeschäfte	Barsicherheiten	Zahlungsmittel	80	k. A.	k. A.	USD	Großbritannien	FED, Bilateral
Emerging Markets Corporate Bond Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Bills	Treasury	2.332	AAA	3 Monate - 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Notes	Treasury	6.235	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Frankreich	FED, Bilateral
PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Notes	Treasury	72	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Notes	Treasury	2.549	AAA	3 Monate - 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Notes	Treasury	27	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
PIMCO ESG Income Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Notes	Treasury	45.259	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Frankreich	FED, Bilateral
Euro Bond Fund	Pensionsgeschäfte			€					
		BNG Bank NV	Treasury	11.063	AAA	Mehr als 1 Jahr	EUR	Frankreich	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Notes	Treasury	62	AAA	3 Monate - 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
Euro Credit Fund	Pensionsgeschäfte	BNG Bank NV	Treasury	2.774	AAA	Mehr als 1 Jahr	EUR	Frankreich	FED, Bilateral
		Bpifrance SACA	Treasury	48	AA	Mehr als 1 Jahr	EUR	Frankreich	FED, Bilateral
		Caisse d'Amortissement de la Dette Sociale	Treasury	56	AA	Mehr als 1 Jahr	EUR	Frankreich	FED, Bilateral
		Rat der Europäischen Entwicklungsbank	Treasury	78	AA+	Mehr als 1 Jahr	EUR	Frankreich	FED, Bilateral
		Europäischer Stabilitätsmechanismus	Treasury	4.996	AAA	Mehr als 1 Jahr	EUR	Frankreich	FED, Bilateral
		Europäische Investitionsbank	Treasury	6.798	AAA	Mehr als 1 Jahr	EUR	Frankreich	FED, Bilateral

Fonds	Wertpapierart	Beschreibung der Sicherheiten	Art Sicherheiten	Markt-wert (000S)	Qualität	Fälligkeits-profil der Sicherheiten	Währung Sicherheiten	Gründungs-land des Kontrahenten	Abrechnungs- und Verrechnungssystem
		Europäische Union	Treasury	€ 12.520	AAA	Mehr als 1 Jahr	EUR	Frankreich	FED, Bilateral
		Kreditanstalt für Wiederaufbau	Unternehmensanleihen	979	AAA	3 Monate - 1 Jahr	EUR	Frankreich	FED, Bilateral
		Kreditanstalt für Wiederaufbau	Unternehmensanleihen	3.452	AAA	Mehr als 1 Jahr	EUR	Frankreich	FED, Bilateral
		Landwirtschaftliche Rentenbank	Unternehmensanleihen	8.536	AAA	Mehr als 1 Jahr	EUR	Frankreich	FED, Bilateral
		Land Nordrhein-Westfalen	Treasury	837	AAA	Mehr als 1 Jahr	EUR	Frankreich	FED, Bilateral
		UNEDIC	Treasury	1.626	AA	Mehr als 1 Jahr	EUR	Frankreich	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Bills	Treasury	940	AAA	3 Monate - 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
Euro Income Bond Fund	Pensionsgeschäfte	BNG Bank NV	Treasury	16.819	AAA	Mehr als 1 Jahr	EUR	Frankreich	FED, Bilateral
		Land Berlin	Treasury	102.209	AAA	Mehr als 1 Jahr	EUR	Deutschland	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Bills	Treasury	3.935	AAA	3 Monate - 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
Euro Long Average Duration Fund	Pensionsgeschäfte	Kreditanstalt für Wiederaufbau	Unternehmensanleihen	1.517	AAA	Mehr als 1 Jahr	EUR	Frankreich	FED, Bilateral
Euro Short-Term Fund	Pensionsgeschäfte	BNG Bank NV	Treasury	14.286	AAA	Mehr als 1 Jahr	EUR	Frankreich	FED, Bilateral
PIMCO European High Yield Bond Fund	Pensionsgeschäfte	Kreditanstalt für Wiederaufbau	Unternehmensanleihen	3.743	AAA	Mehr als 1 Jahr	EUR	Frankreich	FED, Bilateral
PIMCO European Short-Term Opportunities Fund	Pensionsgeschäfte	Kreditanstalt für Wiederaufbau	Unternehmensanleihen	4.454	AAA	Mehr als 1 Jahr	EUR	Frankreich	FED, Bilateral
Global Advantage Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Bills	Treasury	$ 1.436	AAA	3 Monate - 1 Jahr	USD	USA	FED, Bilateral
Global Bond Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Bonds	Treasury	307.187	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Inflation Protected Securities	Treasury	269.857	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Notes	Treasury	674.208	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Frankreich	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Notes	Treasury	126.755	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
Global Bond ESG Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Bonds	Treasury	320.650	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Großbritannien	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Inflation Protected Securities	Treasury	36.147	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Notes	Treasury	281.796	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Frankreich	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Notes	Treasury	543.261	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
Global Bond Ex-US Fund	Swap-Kontrakte	Barsicherheiten	Zahlungsmittel	530	k. A.	k. A.	USD	Frankreich	FED, Bilateral
	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Bills	Treasury	1.658	AAA	3 Monate - 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
PIMCO Global Core Asset Allocation Fund	Swap-Kontrakte	Barsicherheiten	Zahlungsmittel	1.660	k. A.	k. A.	USD	Frankreich	FED, Bilateral
		Barsicherheiten	Zahlungsmittel	1.560	k. A.	k. A.	USD	Großbritannien	FED, Bilateral
		Barsicherheiten	Zahlungsmittel	590	k. A.	k. A.	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Bills	Treasury	11.461	AAA	3 Monate - 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Inflation Protected Securities	Treasury	7.418	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Frankreich	FED, Bilateral
Global High Yield Bond Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Bills	Treasury	7.968	AAA	3 Monate - 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Bonds	Treasury	3.674	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
	Umgekehrte Pensionsgeschäfte	Barsicherheiten	Zahlungsmittel	205	k. A.	k. A.	USD	Großbritannien	FED, Bilateral
Global Investment Grade Credit Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Bills	Treasury	29.808	AAA	3 Monate - 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Bonds	Treasury	31.422	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Notes	Treasury	15.695	AAA	3 Monate - 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
Global Investment Grade Credit ESG Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Notes	Treasury	15.545	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
Global Low Duration Real Return Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Bills	Treasury	1.074	AAA	3 Monate - 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
Global Real Return Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Notes	Treasury	2.290	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
	Umgekehrte Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Bonds	Treasury	101	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
Income Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Bills	Treasury	404.498	AAA	Bis zu 1 Monat	USD	Großbritannien	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Bills	Treasury	82.219	AAA	3 Monate - 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Bonds	Treasury	9.894	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Frankreich	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Bonds	Treasury	747.747	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Inflation Protected	Treasury	323.152	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Notes	Treasury	257.998	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Großbritannien	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Notes	Treasury	1.673.042	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
	Umgekehrte Pensionsgeschäfte	Barsicherheiten	Zahlungsmittel	273	k. A.	k. A.	USD	Großbritannien	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Bonds	Treasury	1	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Großbritannien	FED, Bilateral
Inflation Multi-Asset Fund	Swap-Kontrakte	Barsicherheiten	Zahlungsmittel	240	k. A.	k. A.	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
	Pensionsgeschäfte	Freddie Mac	Mortgage Pass Thru	38.846	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Notes	Treasury	3.080	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral

Fonds	Wertpapierart	Beschreibung der Sicherheiten	Art Sicherheiten	Markt-wert (000S)	Qualität	Fälligkeits-profil der Sicherheiten	Währung Sicherheiten	Gründungs-land des Kontrahenten	Abrechnungs- und Verrechnungssystem
Low Average Duration Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Notes	Treasury	$ 975	AAA	3 Monate - 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
Low Duration Global Investment Grade Credit Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Notes	Treasury	1.636	AAA	3 Monate - 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
Low Duration Income Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Bills	Treasury	5.540	AAA	3 Monate - 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Notes	Treasury	96.407	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Großbritannien	FED, Bilateral
Low Duration Opportunities Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Notes	Treasury	121.176	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund	Swap-Kontrakte	Barsicherheiten	Zahlungs mittel	370	k. A.	k. A.	USD	USA	FED, Bilateral
	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Notes	Treasury	827	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
Mortgage Opportunities Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Bills	Treasury	3.690	AAA	3 Monate - 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Notes	Treasury	14.004	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Frankreich	FED, Bilateral
	Umgekehrte Pensionsgeschäfte	Barsicherheiten	Zahlungs mittel	4.656	k. A.	k. A.	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
StocksPLUS™ Fund	Pensionsgeschäfte	Province of Ontario	Treasury	36.902	AA-	Mehr als 1 Jahr	CAD	Kanada	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Bills	Treasury	15.038	AAA	3 Monate - 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Bonds	Treasury	107.013	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
PIMCO StocksPLUS™ AR Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Notes	Treasury	1.227	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Frankreich	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Notes	Treasury	178	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
Strategic Income Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Bills	Treasury	797	AAA	3 Monate - 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
Total Return Bond Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Bonds	Treasury	26.800	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Notes	Treasury	5.911	AAA	3 Monate - 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Notes	Treasury	141.780	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Notes	Treasury	23.169	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Frankreich	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Notes	Treasury	4.847	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
UK Corporate Bond Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Bills	Treasury	£ 181	AAA	3 Monate - 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
UK Long Term Corporate Bond Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Bills	Treasury	274	AAA	3 Monate - 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
US High Yield Bond Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Bills	Treasury	$ 9.454	AAA	3 Monate - 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
US Investment Grade Corporate Bond Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Bonds	Treasury	13.133	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Notes	Treasury	2.635	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
US Short-Term Fund	Pensionsgeschäfte	U.S. Treasury Bills	Treasury	2.725	AAA	3 Monate - 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral
		U.S. Treasury Notes	Treasury	154.836	AAA	Mehr als 1 Jahr	USD	Vereinigte Staaten	FED, Bilateral

Der Marktwert der Sicherheiten für Pensionsgeschäfte umfasst aufgelaufene Zinsen.

Rahmenverträge für Termingeschäfte decken eine Kombination aus Buy-Sellback-Geschäften, Sale-Buyback-Geschäften und sonstigen Finanzierungsgeschäften ab, die oben nicht enthalten sind. Der Gesamtbetrag der zum 30. Juni 2023 und zum 31. Dezember 2022 für alle Sicherheiten, die für gemäß diesen Vereinbarungen abgeschlossene Geschäfte erhalten wurden, ist oben enthalten. Es ist nicht möglich, die Sicherheiten für jedes einzelne Wertpapierfinanzierungsgeschäft separat zu analysieren.

ISDA-Vereinbarungen decken eine Kombination von Swap-Kontrakten ab; der Gesamtbetrag der Sicherheiten für diese Vereinbarungen ist in den obigen Angaben enthalten.

Ein Teil der angegebenen Sicherheiten bezieht sich auf Derivate, die nicht unter die SFTR fallen.

(iv) Angaben zur Wiederverwendung von Sicherheiten:
Als Sicherheiten erhaltene Wertpapiere wurden zum 30. Juni 2023 und zum 31. Dezember 2022 nicht wiederverwendet.

Die zum 30. Juni 2023 und zum 31. Dezember 2022 erhaltenen Sicherheiten wurden im Depotbanknetz der State Street Bank and Trust gehalten.

(v) Verwahrung gestellter Sicherheiten:
Die von den Fonds zum 30. Juni 2023 und zum 31. Dezember 2022 verpfändeten Sicherheiten werden von den Kontrahenten in Konten gehalten, bei denen es sich nicht um getrennte oder Sammelkonten handelt.

(c) Rendite/Kosten
Die nachfolgenden Tabellen liefern detaillierte Angaben zur Rendite und den Kosten jeder Art von SFT und Total Return Swap für die Berichtszeiträume zum 30. Juni 2023 und zum 30. Juni 2022. Die Beträge sind in der Basiswährung der Fonds ausgewiesen.

	30. Jun. 2023							
	Pensions-geschäfte		Umgekehrte Pensionsgeschäfte		Buy-Sellback-Finanzierungs-geschäfte		Rückkauf-Finanzierungs-geschäfte	
Fonds	Renditen (000S)	Kosten (000S)	Renditen (000S)	Kosten (000S)	Renditen (000S)	Kosten (000S)	Renditen (000S)	Kosten (000S)
PIMCO Asia High Yield Bond Fund	$ 733	$ 0	$ 0	$ (61)	$ 0	$ 0	$ 0	$ 0
Asia Strategic Interest Bond Fund	22	0	0	0	0	0	0	0
PIMCO Capital Securities Fund	1.818	0	133	(8.854)	0	0	0	0
PIMCO Climate Bond Fund	1.017	0	1	(4)	0	0	0	0
Commodity Real Return Fund	229	0	0	(9.180)	0	(2)	0	(64)
PIMCO Credit Opportunities Bond Fund	282	0	0	0	0	0	0	(1)
Diversified Income Fund	30.043	0	0	(330)	0	0	0	0
Diversified Income Duration Hedged Fund	2.075	0	0	(1)	0	0	0	0
Diversified Income ESG Fund	62	0	0	0	0	0	0	0
Dynamic Bond Fund	15.666	0	0	0	0	0	0	0

Fonds	30. Jun. 2023							
	Pensions-geschäfte		Umgekehrte Pensionsgeschäfte		Buy-Sellback-Finanzierungs-geschäfte		Rückkauf-Finanzierungs-geschäfte	
	Renditen (000S)	Kosten (000S)	Renditen (000S)	Kosten (000S)	Renditen (000S)	Kosten (000S)	Renditen (000S)	Kosten (000S)
Dynamic Multi-Asset Fund	€ 2.823	€ 0	€ 0	€ (6)	€ 0	€ 0	€ 0	€ 0
Emerging Local Bond Fund	$ 304	$ 0	$ 0	$ (4.900)	$ 0	$ 0	$ 0	$ 0
Emerging Local Bond ESG Fund	0	0	0	(3)	0	0	0	0
Emerging Markets Bond Fund	71	0	0	(2.061)	0	0	0	(170)
Emerging Markets Bond ESG Fund	1.572	0	0	(900)	0	0	0	(6)
Emerging Markets Corporate Bond Fund	39	0	0	(2)	0	0	0	0
PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund	173	0	0	(14)	0	0	0	0
Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund	136	0	0	0	0	0	0	0
PIMCO ESG Income Fund	1.138	0	0	0	0	0	0	0
Euro Bond Fund	€ 1.126	€ 0	€ 0	€ 0	€ 0	€ 0	€ 0	€ 0
Euro Credit Fund	364	0	0	(4)	0	0	0	0
Euro Income Bond Fund	1.277	0	0	(15)	0	0	0	0
Euro Long Average Duration Fund	65	0	0	(13)	0	0	0	0
Euro Short-Term Fund	186	0	0	0	0	0	0	0
PIMCO European High Yield Bond Fund	125	0	0	(2)	0	0	0	0
PIMCO European Short-Term Opportunities Fund	42	0	0	0	0	0	0	0
Global Advantage Fund	$ 20	$ 0	$ 0	$ (7)	$ 0	$ 0	$ 0	$ (1)
Global Bond Fund	14.063	0	0	(10)	0	0	0	(20)
Global Bond ESG Fund	10.397	0	1	(13)	0	0	0	(5)
Global Bond Ex-US Fund	21	0	0	(8)	0	0	0	(3)
PIMCO Global Core Asset Allocation Fund	443	0	0	(28)	0	0	0	(32)
Global High Yield Bond Fund	285	0	35	0	0	0	0	(6)
Global Investment Grade Credit Fund	11.884	(89)	0	(16)	0	0	0	0
Global Investment Grade Credit ESG Fund	200	0	0	(2.757)	0	0	0	(372)
Global Low Duration Real Return Fund	27	0	0	(8.191)	0	0	0	(303)
Global Real Return Fund	33	0	0	(19.043)	0	0	0	(185)
Income Fund	155.272	0	5	(39)	0	0	0	(89)
Income Fund II	0	(51)	0	0	0	0	0	(20)
Inflation Multi-Asset Fund	409	0	0	0	0	0	0	(5)
Low Average Duration Fund	269	0	13	(2.221)	0	(1)	0	(889)
Low Duration Global Investment Grade Credit Fund	45	0	0	(178)	0	0	0	(264)
Low Duration Income Fund	5.404	0	0	0	0	0	0	0
Low Duration Opportunities Fund	1.654	0	0	(51)	0	0	0	0
PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund	12	0	0	0	0	0	0	0
Mortgage Opportunities Fund	589	0	0	(7.156)	0	0	0	(7)
StocksPLUS™ Fund	10.986	0	0	0	0	0	0	0
PIMCO StocksPLUS™ AR Fund	60	0	0	0	0	0	0	0
Strategic Income Fund	16	0	0	0	0	0	0	0
Total Return Bond Fund	378	0	0	(37)	0	0	0	(8)
PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund	402	0	0	(9)	0	0	0	(17)
UK Corporate Bond Fund	£ 93	£ 0	£ 0	£ (286)	£ 0	£ 0	£ 0	£ 0
UK Long Term Corporate Bond Fund	19	0	0	(117)	0	0	0	0
US High Yield Bond Fund	$ 145	$ 0	$ 16	$ (2)	$ 0	$ 0	$ 0	$ (19)
US Investment Grade Corporate Bond Fund	431	0	0	0	0	0	1	0
US Short-Term Fund	1.618	0	0	(4)	0	0	0	(140)

Fonds	30. Jun. 2022							
	Pensions-geschäfte		Umgekehrte Pensionsgeschäfte		Buy-Sellback-Finanzierungs-geschäfte		Rückkauf-Finanzierungs-geschäfte	
	Renditen (000S)	Kosten (000S)	Renditen (000S)	Kosten (000S)	Renditen (000S)	Kosten (000S)	Renditen (000S)	Kosten (000S)
PIMCO Asia High Yield Bond Fund	$ 60	$ 0	$ 505	$ 0	$ 0	$ 0	$ 0	$ 0
Asia Strategic Interest Bond Fund	4	0	35	0	0	0	0	0
PIMCO Capital Securities Fund	65	0	309	1.383	0	0	0	0
PIMCO Climate Bond Fund	6	0	0	0	0	0	0	0
Commodity Real Return Fund	58	0	0	18	0	0	0	80
PIMCO Credit Opportunities Bond Fund	2	0	0	0	0	0	0	0
Diversified Income Fund	1.661	0	2.118	0	0	0	0	0
Diversified Income Duration Hedged Fund	114	0	57	0	0	0	0	0
Dynamic Bond Fund	48	0	39	0	0	0	0	0
Dynamic Multi-Asset Fund	€ 7	€ 619	€ 13	€ 0	€ 0	€ 0	€ 0	€ 0

	30. Jun. 2022							
	Pensions-geschäfte		Umgekehrte Pensionsgeschäfte		Buy-Sellback-Finanzierungs-geschäfte		Rückkauf-Finanzierungs-geschäfte	
Fonds	Renditen (000S)	Kosten (000S)	Renditen (000S)	Kosten (000S)	Renditen (000S)	Kosten (000S)	Renditen (000S)	Kosten (000S)
Emerging Local Bond Fund	$ 3	$ 0	$ 0	$ 3.248	$ 0	$ 0	$ 0	$ 0
Emerging Markets Bond Fund	51	0	78	250	0	0	0	0
Emerging Markets Bond ESG Fund	70	0	137	196	0	0	0	0
Emerging Markets Corporate Bond Fund	1	0	1	2	0	0	0	0
PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund	64	9	0	0	0	0	0	0
PIMCO ESG Income Fund	20	0	0	0	0	0	0	0
Euro Bond Fund	€ 0	€ 100	€ 14	€ 0	€ 0	€ 0	€ 0	€ 0
Euro Credit Fund	2	63	4	0	0	0	0	0
Euro Income Bond Fund	0	99	38	0	0	0	0	0
Euro Long Average Duration Fund	0	8	0	0	0	0	0	0
Euro Short-Term Fund	0	51	0	0	0	0	0	0
PIMCO European High Yield Bond Fund	0	25	2	0	0	0	0	0
PIMCO European Short-Term Opportunities Fund	0	29	4	0	0	0	0	0
Global Advantage Fund	$ 0	$ 0	$ 120	$ 29	$ 0	$ 0	$ 0	$ 8
Global Bond Fund	557	0	2.813	229	0	0	0	20
Global Bond ESG Fund	231	0	0	6	0	0	0	1
Global Bond Ex-US Fund	1	0	293	31	0	0	0	0
PIMCO Global Core Asset Allocation Fund	6	0	0	0	0	0	0	0
Global High Yield Bond Fund	134	0	169	28	0	0	0	0
Global Investment Grade Credit Fund	28	0	29	103	0	0	0	7
Global Investment Grade Credit ESG Fund	29	0	0	77	0	0	0	31
Global Low Duration Real Return Fund	1	0	0	0	0	0	0	465
Global Real Return Fund	17	0	56	1.862	0	0	0	96
Income Fund	10.275	70	1.605	0	0	0	0	6
Income Fund II	2	0	0	0	0	0	0	0
Inflation Multi-Asset Fund	121	0	0	0	0	0	0	0
Low Average Duration Fund	117	0	0	3	0	0	204	0
Low Duration Global Investment Grade Credit Fund	4	0	0	0	0	0	20	0
Low Duration Income Fund	66	0	0	0	0	0	0	0
Low Duration Opportunities Fund	458	0	7	0	0	0	0	0
Mortgage Opportunities Fund	1	0	0	701	0	0	0	7
StocksPLUS™ Fund	310	0	0	0	0	0	0	0
PIMCO StocksPLUS™ AR Fund	3	0	0	0	0	0	0	0
Strategic Income Fund	1	0	0	0	0	0	0	0
Total Return Bond Fund	122	0	19	380	0	0	0	31
PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund	9	0	0	0	0	0	0	0
UK Corporate Bond Fund	£ 137	£ 0	£ 0	£ 114	£ 0	£ 0	£ 0	£ 0
UK Long Term Corporate Bond Fund	17	0	0	37	0	0	0	0
US High Yield Bond Fund	$ 83	$ 0	$ 17	$ 33	$ 0	$ 0	$ 0	$ 0
US Investment Grade Corporate Bond Fund	0	0	0	8	0	0	0	11
US Short-Term Fund	5	0	0	435	0	0	0	192

Alle Renditen aus SFT-Derivatgeschäften laufen zugunsten des Fonds auf und fallen nicht unter Ertragsteilungsvereinbarungen mit der Verwaltungsgesellschaft der Gesellschaft oder sonstigen Dritten.

For Total Return Swaps lassen sich die Transaktionskosten nicht separat identifizieren. Für diese Anlagen sind die Transaktionskosten im Kauf- und Verkaufspreis enthalten und bilden Teil des Bruttoanlageergebnisses jedes Fonds. Renditen werden als realisierte Gewinne und Veränderungen der nicht realisierten Gewinne auf den Swap-Kontrakt während des Berichtszeitraums identifiziert und sind in der Betriebsergebnisrechnung im realisierten Nettogewinn/(-verlust) aus derivativen Finanzinstrumenten sowie in der Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus derivativen Finanzinstrumenten enthalten.

21. WESENTLICHE EREIGNISSE

Im Februar 2022 startete Russland eine Invasion in die Ukraine, was zu Sanktionen gegen verschiedene russische Unternehmen und Personen führte. Die Fonds können in Wertpapiere und Instrumente anlegen, die wirtschaftlich an Russland gebunden sind. Solche Anlagen könnten durch die Sanktionen und Gegensanktionen Russlands negativ beeinflusst worden sein, einschließlich Wertverlusten und Liquiditätsrückgängen. Die Liquiditätsrückgänge von Anlagen, die mit Russland verbunden sind, können dazu führen, dass die Fonds Portfoliobestände zu einem ungünstigen Zeitpunkt oder Preis verkaufen oder weiterhin mit Russland verbundene Anlagen halten, die die Fonds möglicherweise nicht mehr halten möchten. PIMCO wird diese Positionen weiterhin aktiv im besten Interesse der Fonds und ihrer Anteilinhaber verwalten.

Am 01. Januar 2023 lief der Verzicht auf die Verwaltungsgebühr für den Income Fund II ab. Am gleichen Tag lief der Verzicht auf die Verwaltungsgebühr für den Low Duration Income Fund ab und die Verwaltungsgebühr wurde dauerhaft gesenkt.

Am 03. Januar 2023 wurde der Verzicht auf die Verwaltungsgebühr für den Low Duration Income Fund und den Income Fund II geändert.

Am 18. Januar 2023 wurde der Verzicht auf die Verwaltungsgebühr für den Euro Short-Term Fund und den PIMCO European Short-Term Opportunities Fund geändert.

Am 26. Januar 2023 wurde der Gesellschaftssekretär von State Street Fund Services (Ireland) Limited in Walkers Corporate Services (Ireland) Limited geändert.

Am 06. April 2023 wurde von der Verwaltungsgesellschaft eine Zeichnung in Höhe von 5.000.000 USD im US Short-Term Fund durchgeführt.

Am 26. April 2023 wurde von der Verwaltungsgesellschaft eine Rücknahme in Höhe von 11.580.279 USD aus dem US Short-Term Fund durchgeführt.

Am 01. Juni 2023 lief der Verzicht auf die Verwaltungsgebühr für die Investor Accumulation Class des PIMCO Climate Bond Fund ab.

Am 30. Juni 2023 wurde die Ergänzung für den Euro Credit Fund aktualisiert, um den Verzicht auf die Verwaltungsgebühr in Höhe von 25 BPS für die Anteilsklasse H Institutional um ein Jahr auf den 30. Juni 2024 zu verlängern.

Abgesehen von den oben erwähnten Ereignissen waren während des Berichtszeitraums keine wesentlichen Ereignisse zu verzeichnen.

22. EREIGNISSE NACH ABSCHLUSS DES BERICHTSZEITRAUMS

Am 18. August 2023 wurde die Kreditfazilitätsvereinbarung, die PIMCO Funds: Global Investors Series plc im Namen des Global High Yield Bond Fund und des US High Yield Bond Fund mit bestimmten Kreditgebern, darunter MUFG Bank Ltd. („MUFG“), abgeschlossen hat, geändert und auf den PIMCO Asia High Yield Bond Fund ausgedehnt. Zum 25. August 2023 hat kein Fonds Kredite im Rahmen der Kreditfazilitätsvereinbarung aufgenommen. Weitere Einzelheiten werden im geprüften Jahresabschluss für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 bereitgestellt.

Abgesehen von den oben erwähnten Ereignissen waren während des Berichtszeitraums keine wesentlichen Ereignisse zu verzeichnen.

23. GENEHMIGUNG VON FINANZABSCHLÜSSEN

Dieser Abschluss wurde am 25. August 2023 vom Verwaltungsrat genehmigt.

BESCHREIBUNG		AKTIEN		KOSTEN (000S)
KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2023				
PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)		41.324.787	$	411.499
		PAR (000S)		
Standard Chartered PLC 7,750 % fällig am 15.08.2027	$	40.400		40.538
Mongolia Government International Bond 8,650 % fällig am 19.01.2028		28.270		27.934
Shriram Finance Ltd. 4,400 % fällig am 13.03.2024		25.154		24.632
Sino-Ocean Land Treasure Ltd. 3,250 % fällig am 05.05.2026		32.250		24.086
Indonesia Government International Bond 4,650 % fällig am 20.09.2032		21.684		21.457
Bangkok Bank PCL 5,000 % fällig am 23.09.2025		18.400		17.447
Huarong Finance Co. Ltd. 4,750 % fällig am 27.04.2027		18.100		15.569
SK Hynix, Inc. 6,375 % fällig am 17.01.2028		15.200		15.126
Sino-Ocean Land Treasure Ltd. 2,700 % fällig am 13.01.2025		21.200		15.109
Yunda Holding Investment Ltd. 2,250 % fällig am 19.08.2025		15.600		14.077
Wanda Properties Global Co. Ltd. 11,000 % fällig am 20.01.2025		14.000		13.668
ReNew Wind Energy AP2 4,500 % fällig am 14.07.2028		15.800		13.431
Standard Chartered PLC 6,000 % fällig am 26.07.2025		13.400		13.200
Adaro Indonesia PT 4,250 % fällig am 31.10.2024		13.590		13.133
Wynn Macau Ltd. 4,500 % fällig am 07.03.2029		12.300		13.029
Huarong Finance Co. Ltd. 3,250 % fällig am 13.11.2024		13.900		12.967
Huarong Finance Co. Ltd. 3,750 % fällig am 29.05.2024		13.500		12.925
SK Broadband Co. Ltd. 4,875 % fällig am 28.06.2028		12.950		12.856
Huarong Finance Co. Ltd. 5,000 % fällig am 19.11.2025		13.100		11.595
Sands China Ltd. 5,900 % fällig am 08.08.2028		11.700		11.346
Agile Group Holdings Ltd. 5,500 % fällig am 17.05.2026		27.010		11.343
Huarong Finance Co. Ltd. 4,500 % fällig am 29.05.2029		14.300		11.201

BESCHREIBUNG		AKTIEN		ERLÖSE (000S)
VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2023				
PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)		38.107.620	$	379.478
		PAR (000S)		
Sands China Ltd. 5,625 % fällig am 08.08.2025	$	26.900		26.621
Freeport Indonesia PT 5,315 % fällig am 14.04.2032		21.800		20.424
Muthoot Finance Ltd. 4,400 % fällig am 02.09.2023		19.800		19.483
Krung Thai Bank PCL 4,400 % fällig am 25.03.2026		18.800		17.128
Greenko Solar Mauritius Ltd. 5,950 % fällig am 29.07.2026		15.800		14.868
Yanlord Land HK Co. Ltd. 5,125 % fällig am 20.05.2026		16.800		14.867
India Green Power Holdings 4,000 % fällig am 22.02.2027		16.600		14.360
NWD Finance BVI Ltd. 5,250 % fällig am 22.03.2026		16.200		13.870
NWD Finance BVI Ltd. 4,800 % fällig am 09.09.2023		17.200		12.468
Indika Energy Capital Pte. Ltd. 8,250 % fällig am 22.10.2025		12.400		12.277
HSBC Holdings PLC 6,000 % fällig am 22.05.2027		12.700		12.171
NWD Finance BVI Ltd. 6,150 % fällig am 16.03.2025		11.300		10.525
SK Hynix, Inc. 6,375 % fällig am 17.01.2028		10.300		10.482
Lenovo Group Ltd. 5,875 % fällig am 24.04.2025		10.000		10.024
Mongolia Government International Bond 5,625 % fällig am 01.05.2023		10.022		9.972
Zhongsheng Group Holdings Ltd. 0,000 % fällig am 21.05.2025	HKD	69.000		9.705
Standard Chartered PLC 7,750 % fällig am 15.08.2027	$	9.400		9.230
Huarong Finance Co. Ltd. 4,500 % fällig am 29.05.2029		10.700		9.202
Freeport Indonesia PT 4,763 % fällig am 14.04.2027		9.200		8.855

(a) Der PIMCO Asia High Yield Bond Fund legt in Anteile eines verbundenen Fonds an.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Fondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

BESCHREIBUNG		AKTIEN		KOSTEN (000S)
KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2023				
PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)		8.563.541	$	85.277
		PAR (000S)		
Korea Housing Finance Corp. 4,625 % fällig am 24.02.2028	$	7.100		7.039
Kasikornbank PCL 5,458 % fällig am 07.03.2028		5.600		5.600
POSCO 5,750 % fällig am 17.01.2028		3.700		3.682
Export-Import Bank of Korea 5,000 % fällig am 11.01.2028		3.500		3.520
Korea National Oil Corp. 4,875 % fällig am 03.04.2028		3.500		3.506
SK Hynix, Inc. 2,375 % fällig am 19.01.2031		4.620		3.477
SMBC Aviation Capital Finance DAC 5,450 % fällig am 03.05.2028		3.400		3.401
SK on Co. Ltd. 5,375 % fällig am 11.05.2026		3.400		3.397
Bank Mandiri Persero Tbk PT 5,500 % fällig am 04.04.2026		2.900		2.888
India Toll Roads 5,500 % fällig am 19.08.2024		2.700		2.594
NWD Finance BVI Ltd. 4,125 % fällig am 10.03.2028		3.550		2.523
Korea Mine Rehabilitation & Mineral Resources Corp. 5,375 % fällig am 11.05.2028		2.450		2.431
Standard Chartered PLC 6,301 % fällig am 09.01.2029		2.300		2.303
Woori Bank 4,875 % fällig am 26.01.2028		2.200		2.192
SK Hynix, Inc. 6,375 % fällig am 17.01.2028		2.200		2.189
Standard Chartered PLC 7,750 % fällig am 15.08.2027		2.100		2.110
Vietnam Government International Bond 5,500 % fällig am 12.03.2028		2.000		1.940
Adaro Indonesia PT 4,250 % fällig am 31.10.2024		1.900		1.834
Melco Resorts Finance Ltd. 5,750 % fällig am 21.07.2028		2.100		1.759

BESCHREIBUNG		AKTIEN		ERLÖSE (000S)
VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2023				
PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)		9.459.862	$	94.200
		PAR (000S)		
Korea National Oil Corp. 2,125 % fällig am 18.04.2027	$	5.300		4.808
ONGC Videsh Ltd. 3,750 % fällig am 07.05.2023		4.100		4.082
Indonesia Government International Bond 4,650 % fällig am 20.09.2032		4.000		3.944
Export-Import Bank of Korea 5,000 % fällig am 11.01.2028		3.500		3.573
Periama Holdings LLC 5,950 % fällig am 19.04.2026		3.500		3.378
Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia 4,400 % fällig am 06.06.2027		3.200		3.165
Kasikornbank PCL 5,458 % fällig am 07.03.2028		2.900		2.995
SK Hynix, Inc. 2,375 % fällig am 19.01.2031		3.600		2.730
Sinopec Group Overseas Development Ltd. 4,250 % fällig am 12.09.2028		2.300		2.250
Muang Thai Life Assurance PCL 3,552 % fällig am 27.01.2037		2.600		2.249
SK Hynix, Inc. 6,375 % fällig am 17.01.2028		2.200		2.209
Celestial Miles Ltd. 5,750 % fällig am 31.01.2024		2.200		2.175
Star Energy Geothermal Wayang Windu Ltd. 6,750 % fällig am 24.04.2033		2.189		2.160
Oversea-Chinese Banking Corp. Ltd. 4,250 % fällig am 19.06.2024		2.100		2.079
Korea Hydro & Nuclear Power Co. Ltd. 4,250 % fällig am 27.07.2027		2.000		1.939
Adaro Indonesia PT 4,250 % fällig am 31.10.2024		1.900		1.834
LG Chem Ltd. 2,375 % fällig am 07.07.2023		2.000		1.652
GC Treasury Center Co. Ltd. 2,980 % fällig am 18.03.2031		1.900		1.544
Wynn Macau Ltd. 5,500 % fällig am 15.01.2026		1.600		1.465

(a) Der Asia Strategic Interest Bond Fund legt in Anteile eines verbundenen Fonds an.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Fondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

BESCHREIBUNG		PAR (000S)		KOSTEN (000S)
KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2023				
Credit Agricole S.A. 7,250 % fällig am 23.09.2028	€	117.500	$	125.610
Lloyds Banking Group PLC 8,500 % fällig am 27.03.2028	£	54.000		66.135
Barclays PLC 9,250 % fällig am 15.09.2028		49.500		59.529
ING Groep NV 7,500 % fällig am 16.05.2028	$	56.400		55.970
HSBC Holdings PLC 8,000 % fällig am 07.03.2028		54.700		54.194
Intesa Sanpaolo SpA 7,778 % fällig am 20.06.2054		48.400		48.400
Deutsche Bank AG 7,079 % fällig am 10.02.2034		46.371		46.326
Santander UK Group Holdings PLC 6,750 % fällig am 24.06.2024	£	36.675		42.698
HSBC Holdings PLC 6,000 % fällig am 29.09.2023	€	36.831		39.440
Lloyds Banking Group PLC 8,000 % fällig am 27.09.2029	$	43.280		37.626
Svenska Handelsbanken AB 4,375 % fällig am 01.03.2027		44.600		37.295
Societe Generale S.A. 6,691 % fällig am 10.01.2034		36.200		37.133
CaixaBank S.A. 8,250 % fällig am 13.03.2029	€	29.600		31.588
Svenska Handelsbanken AB 4,750 % fällig am 01.03.2031	$	35.800		29.312
Electricite de France S.A. 9,125 % fällig am 15.03.2033		23.800		24.201
Societe Generale S.A. 7,875 % fällig am 18.12.2023		23.600		23.549
Morgan Stanley 5,948 % fällig am 19.01.2038		23.400		23.400
Barclays PLC 8,000 % fällig am 15.06.2024		23.350		23.199
BNP Paribas S.A. 7,375 % fällig am 11.06.2030	€	21.800		23.162
NatWest Group PLC 6,000 % fällig am 29.12.2025	$	24.300		22.097
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A. 8,375 % fällig am 21.06.2028	€	20.200		21.821
Societe Generale S.A. 7,875 % fällig am 18.12.2023		19.400		20.862
HSBC Holdings PLC 6,161 % fällig am 09.03.2029	$	20.000		20.000
NatWest Group PLC 4,600 % fällig am 28.06.2031		25.000		19.679
BNP Paribas S.A. 9,250 % fällig am 17.11.2027		18.000		19.404
BNP Paribas S.A. 7,750 % fällig am 16.08.2029		19.665		19.238
HSBC Holdings PLC 6,000 % fällig am 22.05.2027		19.300		17.225
Credit Agricole S.A. 7,875 % fällig am 23.01.2024		17.200		17.137
Intesa Sanpaolo SpA 8,248 % fällig am 21.11.2033		16.000		16.511
Bank Leumi Le-Israel B.M. 7,129 % fällig am 18.07.2033		16.200		16.200
Lloyds Banking Group PLC 7,875 % fällig am 27.06.2029	£	14.041		16.183
de Volksbank NV 7,000 % fällig am 15.12.2027	€	16.000		16.129
Deutsche Bank AG 5,000 % fällig am 05.09.2030		15.800		15.913
Lloyds Banking Group PLC 7,500 % fällig am 27.06.2024	$	15.800		15.682
ING Groep NV 3,875 % fällig am 16.05.2027		22.158		15.644
Lloyds Banking Group PLC 4,947 % fällig am 27.06.2025	€	14.982		15.384

BESCHREIBUNG		PAR (000S)		ERLÖSE (000S)
VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2023				
HSBC Holdings PLC 4,750 % fällig am 04.07.2029	€	83.102	$	78.626
BNP Paribas S.A. 7,000 % fällig am 16.08.2028	$	56.700		55.964
CaixaBank S.A. 5,250 % fällig am 23.03.2026	€	54.000		51.184
Intesa Sanpaolo SpA 7,750 % fällig am 11.01.2027		45.300		47.981
Societe Generale S.A. 6,221 % fällig am 15.06.2033	$	49.800		47.552
Barclays PLC 8,875 % fällig am 15.09.2027	£	36.200		40.562
Societe Generale S.A. 6,750 % fällig am 06.04.2028	$	44.300		38.270
Deutsche Bank AG 3,742 % fällig am 07.01.2033		49.100		38.161
RCI Banque S.A. 2,625 % fällig am 18.02.2030	€	36.500		36.562
ING Groep NV 5,750 % fällig am 16.11.2026	$	39.300		35.228
Barclays PLC 8,000 % fällig am 15.03.2029		40.000		34.259
Barclays PLC 9,250 % fällig am 15.09.2028	£	30.000		33.921
Barclays PLC 6,375 % fällig am 15.12.2025		30.764		32.967
Electricite de France S.A. 2,875 % fällig am 15.12.2026	€	33.600		30.259
Abertis Infraestructuras Finance BV 2,625 % fällig am 26.01.2027		35.800		30.190
Deutsche Bank AG 4,500 % fällig am 30.11.2026		39.400		30.073
Barclays PLC 6,125 % fällig am 15.12.2025	$	35.300		29.859
BNP Paribas S.A. 6,875 % fällig am 06.12.2029	€	27.400		28.694
BNP Paribas S.A. 9,250 % fällig am 17.11.2027	$	24.300		26.298
UBS Group AG 4,194 % fällig am 01.04.2031		32.900		26.172
Legal & General Group PLC 5,625 % fällig am 24.03.2031	£	26.300		26.142
UBS Group AG 7,000 % fällig am 31.01.2024	$	24.958		24.958
NatWest Group PLC 7,416 % fällig am 06.06.2033	£	17.500		22.490
Erste Group Bank AG 4,250 % fällig am 15.10.2027	€	26.800		22.307
Banco Mercantil del Norte S.A. 8,375 % fällig am 14.10.2030	$	23.900		21.730
Deutsche Bank AG 7,079 % fällig am 10.02.2034		23.186		21.308
Lloyds Banking Group PLC 8,500 % fällig am 27.03.2028	£	18.100		21.144
UBS Group AG 4,375 % fällig am 10.02.2031	$	25.200		20.339
Deutsche Bank AG 3,729 % fällig am 14.01.2032		26.875		20.232
NatWest Group PLC 4,600 % fällig am 28.06.2031		27.100		19.749
Swedbank AB 4,000 % fällig am 17.03.2029		26.000		19.284
HSBC Holdings PLC 8,000 % fällig am 07.03.2028		19.300		19.141

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Fondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des PIMCO Climate Bond Fund

BESCHREIBUNG		PAR (000S)	KOSTEN (000S)
KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2023			
Europäische Investitionsbank 3,750 % fällig am 14.02.2033	$	5.000	$ 4.974
Caja Rural de Navarra SCC 3,000 % fällig am 26.04.2027	€	2.100	2.271
Nordea Bank Abp 6,000 % fällig am 02.06.2026	£	1.800	2.236
Hyundai Capital America 5,800 % fällig am 26.06.2025	$	2.200	2.197
TDC Net A/S 5,618 % fällig am 06.02.2030	€	1.900	2.071
PNC Financial Services Group, Inc. 4,758 % fällig am 26.01.2027	$	2.000	2.000
DNB Bank ASA 3,625 % fällig am 16.02.2027	€	1.700	1.825
Regie Autonome des Transports Parisiens 3,250 % fällig am 11.04.2033		1.400	1.523
Bank of America Corp. 4,134 % fällig am 12.06.2028		1.400	1.500
AIB Group PLC 4,625 % fällig am 23.07.2029		1.300	1.403
Schneider Electric SE 3,250 % fällig am 12.06.2028		1.200	1.276
Bank of Ireland Group PLC 4,875 % fällig am 16.07.2028		1.100	1.176
Public Service Electric & Gas Co. 4,650 % fällig am 15.03.2033	$	1.100	1.099
SCE Recovery Funding LLC 5,112 % fällig am 14.12.2049		1.000	1.000
United Kingdom Gilt 3,750 % fällig am 22.10.2053	£	800	995
Nederlandse Waterschapsbank NV 3,000 % fällig am 20.04.2033	€	900	987
Alexandria Real Estate Equities, Inc. 2,000 % fällig am 18.05.2032	$	1.200	930
Societe Nationale SNCF S.A. 3,375 % fällig am 25.05.2033	€	800	876
Export-Import Bank of Korea 5,125 % fällig am 11.01.2033	$	850	847
Philippines Government International Bond 5,500 % fällig am 17.01.2048		800	800
Comcast Corp. 4,650 % fällig am 15.02.2033		800	799
Ford Motor Credit Co. LLC 6,800 % fällig am 12.05.2028		800	799
Danske Bank A/S 4,750 % fällig am 21.06.2030	€	700	758
Commerzbank AG 3,375 % fällig am 12.12.2025		700	749
Instituto de Credito Oficial 3,050 % fällig am 31.10.2027		700	748
GoodLeap Sustainable Home Solutions Trust 5,520 % fällig am 22.02.2055	$	700	700
AES Corp. 5,450 % fällig am 01.06.2028		700	700
SK Hynix, Inc. 6,375 % fällig am 17.01.2028		700	697
Hong Kong Government International Bond 5,250 % fällig am 11.01.2053		700	693
Deutsche Bahn Finance GmbH 3,250 % fällig am 19.05.2033	€	600	648
UniCredit Bank Czech Republic & Slovakia A/S 3,750 % fällig am 20.06.2028		600	645
UniCredit Bank Austria AG 3,125 % fällig am 21.09.2029		600	640
CenterPoint Energy Houston Electric LLC 5,300 % fällig am 01.04.2053	$	600	600
Wisconsin Power & Light Co. 4,950 % fällig am 01.04.2033		600	599
Land Securities Capital Markets PLC 4,875 % fällig am 15.09.2034	£	500	586
MidAmerican Energy Co. 3,650 % fällig am 01.08.2048	$	750	578

BESCHREIBUNG		PAR (000S)	ERLÖSE (000S)
VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2023			
U.S. Treasury Notes 0,375 % fällig am 30.11.2025	$	7.490	$ 6.751
U.S. Treasury Notes 1,125 % fällig am 15.01.2025		3.600	3.378
Dominion Energy, Inc. 2,250 % fällig am 15.08.2031		2.350	1.944
DTE Electric Co. 1,900 % fällig am 01.04.2028		2.200	1.936
Liberty Utilities Finance GP 2,050 % fällig am 15.09.2030		2.475	1.911
Avangrid, Inc. 3,800 % fällig am 01.06.2029		1.965	1.827
Public Service Co. of Oklahoma 2,200 % fällig am 15.08.2031		2.050	1.674
Assicurazioni Generali SpA 4,125 % fällig am 04.05.2026	€	1.400	1.535
Forvia 2,375 % fällig am 15.06.2029		1.500	1.296
Verallia S.A. 1,625 % fällig am 14.05.2028		1.300	1.193
Bank of Ireland Group PLC 4,875 % fällig am 16.07.2028		1.100	1.185
AES Corp. 1,375 % fällig am 15.01.2026	$	1.300	1.168
NXP BV 5,000 % fällig am 15.01.2033		1.100	1.086
Valeo S.A. 1,000 % fällig am 03.08.2028	€	1.200	1.032
SCE Recovery Funding LLC 5,112 % fällig am 14.12.2049	$	1.000	985
Public Service Co. of Colorado 3,700 % fällig am 15.06.2028		1.000	960
Enel Finance International NV 0,875 % fällig am 28.09.2034	€	1.300	959
Kilroy Realty LP 2,500 % fällig am 15.11.2032	$	1.300	953
Vesteda Finance BV 0,750 % fällig am 18.10.2031	€	1.200	949
Marks & Spencer PLC 3,750 % fällig am 19.05.2026	£	800	909
UBS AG 5,125 % fällig am 15.05.2024	$	900	893
Export-Import Bank of Korea 5,125 % fällig am 11.01.2033		850	890
Citycon Treasury BV 1,625 % fällig am 12.03.2028	€	1.100	881
ABN AMRO Bank NV 2,470 % fällig am 13.12.2029	$	1.000	841
CaixaBank S.A. 0,750 % fällig am 26.05.2028	€	900	839
Philippines Government International Bond 5,500 % fällig am 17.01.2048	$	800	835
Atlantica Sustainable Infrastructure PLC 4,125 % fällig am 15.06.2028		900	810
Comcast Corp. 4,650 % fällig am 15.02.2033		800	784
Suez SACA 4,625 % fällig am 03.11.2028	€	700	768
Instituto de Credito Oficial 3,050 % fällig am 31.10.2027		700	744
Southern California Edison Co. 2,500 % fällig am 01.06.2031	$	800	664
Verizon Communications, Inc. 2,850 % fällig am 03.09.2041		900	622
Leeward Renewable Energy Operations LLC 4,250 % fällig am 01.07.2029		700	610
SBB Treasury Oyj 1,125 % fällig am 26.11.2029	€	900	565

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Fondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

BESCHREIBUNG		PAR (000S)		KOSTEN (000S)
KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2023				
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 1,625 % fällig am 15.10.2027 (b)	$	67.092	$	68.212
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,375 % fällig am 15.07.2027 (b)		32.610		31.392
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,375 % fällig am 15.01.2027 (b)		22.989		22.028
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.10.2025 (b)		13.843		13.229
United Kingdom Gilt 1,250 % fällig am 22.11.2027	£	8.161		10.368
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 1,400 % fällig am 26.05.2025	€	4.584		4.796
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 1,500 % fällig am 15.02.2053 (b)	$	2.121		2.109
UBS Group AG 4,177 % fällig am 16.01.2026	€	400		394
		AKTIEN		
PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)		246		2

BESCHREIBUNG		PAR (000S)		ERLÖSE (000S)
VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2023				
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,625 % fällig am 15.01.2024 (b)	$	108.835	$	107.256
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.10.2026 (b)		70.611		67.130
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.10.2024 (b)		51.791		50.150
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,500 % fällig am 15.04.2024 (b)		38.784		38.146
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.10.2025 (b)		36.646		35.028
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,375 % fällig am 15.07.2023 (b)		33.655		33.338
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.04.2025 (b)		22.925		22.077
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,250 % fällig am 15.01.2025 (b)		20.504		20.005
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,500 % fällig am 15.01.2028 (b)		19.256		18.236
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.04.2026 (b)		19.151		18.038
United Kingdom Gilt 0,125 % fällig am 22.03.2026	£	12.796		15.454
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,750 % fällig am 15.07.2028 (b)	$	15.727		15.124
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,625 % fällig am 15.04.2023 (b)		13.946		13.850
Nykredit Realkredit A/S 1,000 % fällig am 01.10.2050	DKK	113.300		12.252
Carbone CLO Ltd. 6,390 % fällig am 20.01.2031	$	4.576		4.535
Nykredit Realkredit A/S 1,500 % fällig am 01.10.2053	DKK	42.900		4.471
Madison Park Funding Ltd. 6,010 % fällig am 15.04.2029	$	4.483		4.441
Ares European CLO DAC 3,957 % fällig am 15.10.2031	€	4.000		4.309
Realkredit Danmark A/S 1,000 % fällig am 01.10.2050	DKK	40.200		4.307
Carlyle Global Market Strategies Euro CLO Ltd. 4,073 % fällig am 15.11.2031	€	3.850		4.043

(a) Der Commodity Real Return Fund legt in Anteile eines verbundenen Fonds an.

(b) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Fondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

BESCHREIBUNG		PAR (000S)	KOSTEN (000S)
KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2023			
U.S. Treasury Notes 4,000 % fällig am 29.02.2028	$	15.000	$ 14.888
U.S. Treasury Notes 0,500 % fällig am 31.10.2027		9.900	8.560
		AKTIEN	
PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)		550.196	5.479
		PAR (000S)	
AerCap Ireland Capital DAC 2,875 % fällig am 14.08.2024	$	1.150	1.102
Mattel, Inc. 3,375 % fällig am 01.04.2026		900	828
Station Casinos LLC 4,625 % fällig am 01.12.2031		700	585
Altice France S.A. 5,125 % fällig am 15.07.2029		725	525
Caesars Entertainment, Inc. 7,000 % fällig am 15.02.2030		500	500
Societe Generale S.A. 6,691 % fällig am 10.01.2034		500	499
Vornado Realty LP 2,150 % fällig am 01.06.2026		600	491
Weatherford International Ltd. 6,500 % fällig am 15.09.2028		400	402
Credit Suisse AG 4,713 % fällig am 31.05.2024	€	400	400
Nissan Motor Acceptance Co. LLC 2,450 % fällig am 15.09.2028	$	500	394
Nexi SpA 2,125 % fällig am 30.04.2029	€	400	362
Occidental Petroleum Corp. 7,500 % fällig am 01.05.2031	$	300	328
Alaska Airlines Pass-Through Trust 4,800 % fällig am 15.02.2029		322	310
EP Infrastructure A/S 1,816 % fällig am 02.03.2031	€	400	309
Transocean Titan Financing Ltd. 8,375 % fällig am 01.02.2028	$	300	306
Philip Morris International, Inc. 5,375 % fällig am 15.02.2033		300	304
Valaris Ltd. 8,375 % fällig am 30.04.2030		300	301

BESCHREIBUNG		PAR (000S)	ERLÖSE (000S)
VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2023			
U.S. Treasury Notes 4,000 % fällig am 29.02.2028	$	15.000	$ 15.246
		AKTIEN	
PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)		542.276	5.400
		PAR (000S)	
U.S. Treasury Notes 3,125 % fällig am 31.08.2027	$	3.825	3.727
Netflix, Inc. 5,375 % fällig am 15.11.2029		1.300	1.319
Crown Castle, Inc. 2,250 % fällig am 15.01.2031		1.200	1.001
Buckeye Partners LP 1,000 % fällig am 01.11.2026		986	986
Citigroup, Inc. 6,270 % fällig am 17.11.2033		900	972
USI, Inc. 1,000 % fällig am 02.12.2026		970	970
Air Canada 3,875 % fällig am 15.08.2026		1.025	923
RegionalCare Hospital Partners Holdings, Inc. 9,023 % fällig am 16.11.2025		936	876
Goldman Sachs Group, Inc. 4,482 % fällig am 23.08.2028		900	869
Citigroup, Inc. 3,785 % fällig am 17.03.2033		900	804
DAE Funding LLC 1,550 % fällig am 01.08.2024		800	751
U.S. Treasury Notes 2,750 % fällig am 15.08.2032		800	749
LeasePlan Corp. NV 7,375 % fällig am 29.05.2024	€	700	739
Sprint LLC 7,875 % fällig am 15.09.2023	$	600	604
VeriSign, Inc. 2,700 % fällig am 15.06.2031		700	582
White Cap Parent LLC (8,250 % bar oder 9,000 % PIK) 8,250 % fällig am 15.03.2026		550	506
Manitowoc Co, Inc. 9,000 % fällig am 01.04.2026		500	503
Service Properties Trust 7,500 % fällig am 15.09.2025		500	493

(a) Der PIMCO Credit Opportunities Bond Fund legt in Anteile eines verbundenen Fonds an.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Fondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des Diversified Income Fund

BESCHREIBUNG		AKTIEN		KOSTEN (000S)
KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2023				
PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)		24.229.226	$	241.268
		PAR (000S)		
Saudi Arabia Government International Bond 3,450 % fällig am 02.02.2061	$	34.500		24.317
Occidental Petroleum Corp. 6,625 % fällig am 01.09.2030		20.900		22.475
Verizon Communications, Inc. 2,355 % fällig am 15.03.2032		26.800		21.956
Venture Global LNG, Inc. 8,375 % fällig am 01.06.2031		21.725		21.725
Netflix, Inc. 4,875 % fällig am 15.06.2030		21.000		20.854
Saudi Arabia Government International Bond 4,875 % fällig am 18.07.2033		20.000		20.272
Saudi Arabia Government International Bond 5,000 % fällig am 18.01.2053		20.000		19.153
Peru Government International Bond 8,750 % fällig am 21.11.2033		15.000		19.142
Venture Global LNG, Inc. 8,125 % fällig am 01.06.2028		18.775		18.775
Romania Government International Bond 6,625 % fällig am 27.09.2029	€	14.500		16.268
Mexico Government International Bond 6,350 % fällig am 09.02.2035	$	15.300		16.034
Perusahaan Perseroan Persero PT Perusahaan Listrik Negara 6,150 % fällig am 21.05.2048		15.000		15.142
Sprint Capital Corp. 8,750 % fällig am 15.03.2032		12.000		14.799
South Africa Government International Bond 5,650 % fällig am 27.09.2047		13.700		10.553
Boeing Co. 5,930 % fällig am 01.05.2060		10.000		10.213
Mexico Government International Bond 5,750 % fällig am 12.10.2110		10.000		9.486
Serbia Government International Bond 6,500 % fällig am 26.09.2033		9.400		9.450
AT&T, Inc. 3,800 % fällig am 01.12.2057		12.200		9.177
Venture Global Calcasieu Pass LLC 6,250 % fällig am 15.01.2030		8.800		8.800
Project Mercury 0,000 % fällig am 17.07.2030	€	8.000		8.623
Option One Mortgage Loan Trust 5,430 % fällig am 25.07.2036	$	14.010		8.194

BESCHREIBUNG		AKTIEN		ERLÖSE (000S)
VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2023				
PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)		29.327.235	$	292.033
		PAR (000S)		
Setanta Aircraft Leasing DAC 7,538 % fällig am 05.11.2028	$	48.800		48.721
		AKTIEN		
PIMCO Funds: Global Investors Series plc - PIMCO European High Yield Bond Fund (a)		3.637.652		40.252
		PAR (000S)		
Huarong Finance Co. Ltd. 2,125 % fällig am 30.09.2023	$	38.200		36.947
Nissan Motor Co. Ltd. 4,345 % fällig am 17.09.2027		35.400		32.304
Renault S.A. 2,375 % fällig am 25.05.2026	€	28.500		27.691
Hilton Domestic Operating Co., Inc. 6,939 % fällig am 22.06.2026	$	27.523		27.488
HSBC Holdings PLC 4,300 % fällig am 08.03.2026		26.700		26.026
Deutsche Bank AG 1,625 % fällig am 20.01.2027	€	27.500		25.884
WP/AP Telecom Holdings BV 7,498 % fällig am 30.03.2029		23.100		24.827
Fortune Star BVI Ltd. 3,950 % fällig am 02.10.2026		32.900		24.765
Bellis Acquisition Co. PLC 3,250 % fällig am 16.02.2026	£	23.400		23.734
UBS AG 5,125 % fällig am 15.05.2024	$	22.800		22.581
Ziggo BV 1,000 % fällig am 31.01.2029	€	19.560		19.917
Fraport AG Frankfurt Airport Services Worldwide 1,875 % fällig am 31.03.2028		19.200		18.661
Casino Guichard-Perrachon S.A. 7,108 % fällig am 31.08.2025		22.500		18.351
ZF Finance GmbH 3,750 % fällig am 21.09.2028		18.400		17.424
HSBC Holdings PLC 3,900 % fällig am 25.05.2026	$	15.900		15.247
Deutsche Bank AG 1,375 % fällig am 17.02.2032	€	18.100		14.863
BNP Paribas S.A. 4,705 % fällig am 10.01.2025	$	14.400		14.256
Santander UK Group Holdings PLC 6,750 % fällig am 24.06.2024	£	12.100		14.136
Deutsche Bank AG 1,750 % fällig am 19.11.2030	€	15.700		13.629
Lloyds Banking Group PLC 4,450 % fällig am 08.05.2025	$	13.151		12.840
Petroleos Mexicanos 6,700 % fällig am 16.02.2032		16.100		12.828
INEOS Finance PLC 6,168 % fällig am 08.11.2028	€	12.100		12.399
Credit Agricole S.A. 1,907 % fällig am 16.06.2026	$	13.350		12.267

(a) Der Diversified Income Fund legt in Anteile eines verbundenen Fonds an.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Fondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des Diversified Income Duration Hedged Fund 30. Juni 2023

BESCHREIBUNG		AKTIEN		KOSTEN (000S)
KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2023				
PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)		671.735	$	6.689
		PAR (000S)		
Mexico Government International Bond 5,400 % fällig am 09.02.2028	$	2.800		2.794
Ivory Coast Government International Bond 5,750 % fällig am 31.12.2032		2.985		2.746
Saudi Arabia Government International Bond 4,875 % fällig am 18.07.2033		2.500		2.521
Venture Global LNG, Inc. 8,125 % fällig am 01.06.2028		2.200		2.200
Romania Government International Bond 5,000 % fällig am 27.09.2026	€	2.000		2.190
Saudi Arabia Government International Bond 4,750 % fällig am 18.01.2028	$	2.000		1.993
Gaci First Investment Co. 4,750 % fällig am 14.02.2030		2.000		1.979
Occidental Petroleum Corp. 7,875 % fällig am 15.09.2031		1.700		1.936
Verizon Communications, Inc. 2,355 % fällig am 15.03.2032		2.200		1.802
Sprint Capital Corp. 6,875 % fällig am 15.11.2028		1.385		1.495
Netflix, Inc. 4,875 % fällig am 15.06.2030		1.400		1.391
Peru Government International Bond 8,750 % fällig am 21.11.2033		1.000		1.276
Mexico Government International Bond 3,771 % fällig am 24.05.2061		1.600		1.107
Greensaif Pipelines Bidco SARL 6,129 % fällig am 23.02.2038		1.100		1.100
ACE Securities Corp. Home Equity Loan Trust 5,520 % fällig am 25.02.2037		2.512		1.091
Saudi Arabia Government International Bond 4,500 % fällig am 26.10.2046		1.200		1.084
Perusahaan Perseroan Persero PT Perusahaan Listrik Negara 6,150 % fällig am 21.05.2048		1.000		1.011
Serbia Government International Bond 6,500 % fällig am 26.09.2033		1.000		1.006
Venture Global Calcasieu Pass LLC 6,250 % fällig am 15.01.2030		1.000		1.000
HCA, Inc. 5,500 % fällig am 01.06.2033		1.000		999
Saudi Arabia Government International Bond 3,450 % fällig am 02.02.2061		1.400		963
South Africa Government International Bond 5,650 % fällig am 27.09.2047		1.200		924
WMG Acquisition Corp. 3,000 % fällig am 15.02.2031		1.100		920
Philippines Government International Bond 5,000 % fällig am 17.07.2033		800		800
Charter Communications Operating LLC 3,850 % fällig am 01.04.2061		1.200		759
Occidental Petroleum Corp. 6,625 % fällig am 01.09.2030		700		754
Gaci First Investment Co. 5,125 % fällig am 14.02.2053		800		730
Crown Castle, Inc. 5,000 % fällig am 11.01.2028		700		705
PRA Group, Inc. 8,375 % fällig am 01.02.2028		700		700
Sirius XM Radio, Inc. 4,125 % fällig am 01.07.2030		800		697
DISH Network Corp. 11,750 % fällig am 15.11.2027		675		689
Crown Castle, Inc. 2,250 % fällig am 15.01.2031		800		667
Nokia Oyj 6,625 % fällig am 15.05.2039		600		621

BESCHREIBUNG		AKTIEN		ERLÖSE (000S)
VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2023				
PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)		1.241.436	$	12.362
		PAR (000S)		
Hilton Domestic Operating Co., Inc. 6,939 % fällig am 22.06.2026	$	4.185		4.180
Nissan Motor Co. Ltd. 4,345 % fällig am 17.09.2027		3.500		3.177
Deutsche Bank AG 1,750 % fällig am 19.11.2030	€	3.600		3.176
ZF Finance GmbH 3,750 % fällig am 21.09.2028		3.100		2.934
CommScope, Inc. 4,750 % fällig am 01.09.2029	$	3.600		2.920
Syngenta Finance NV 3,375 % fällig am 16.04.2026	€	2.600		2.736
Banca Monte dei Paschi di Siena SpA 2,625 % fällig am 28.04.2025		2.700		2.709
CGG S.A. 8,750 % fällig am 01.04.2027	$	2.800		2.417
Altice Financing S.A. 5,750 % fällig am 15.08.2029		3.000		2.370
Huarong Finance Co. Ltd. 2,125 % fällig am 30.09.2023		2.400		2.320
UniCredit SpA 7,830 % fällig am 04.12.2023		2.200		2.240
Casino Guichard-Perrachon S.A. 7,108 % fällig am 31.08.2025	€	2.600		2.190
Saudi Arabia Government International Bond 4,750 % fällig am 18.01.2028	$	2.000		2.020
Deutsche Bank AG 3,547 % fällig am 18.09.2031		2.100		1.777
Renault S.A. 2,375 % fällig am 25.05.2026	€	1.800		1.735
Bellis Acquisition Co. PLC 3,250 % fällig am 16.02.2026	£	1.700		1.721
Freedom Mortgage Corp. 7,625 % fällig am 01.05.2026	$	2.100		1.676
Fortune Star BVI Ltd. 3,950 % fällig am 02.10.2026	€	2.000		1.542
Teva Pharmaceutical Finance Netherlands BV 4,500 % fällig am 01.03.2025		1.400		1.470
Deutsche Bank AG 5,882 % fällig am 08.07.2031	$	1.700		1.468
Fraport AG Frankfurt Airport Services Worldwide 1,875 % fällig am 31.03.2028	€	1.500		1.441
Tierra Mojada Luxembourg SARL 5,750 % fällig am 01.12.2040	$	1.663		1.432
Plains All American Pipeline LP 4,900 % fällig am 15.02.2045		1.700		1.366
Level 3 Financing, Inc. 6,967 % fällig am 01.03.2027		1.600		1.320
Nakilat, Inc. 6,067 % fällig am 31.12.2033		1.159		1.214
IHO Verwaltungs GmbH (3,750 % bar oder 4,500 % PIK) 3,750 % fällig am 15.09.2026	€	1.200		1.127
Marks & Spencer PLC 4,500 % fällig am 10.07.2027	£	1.000		1.119
Jaguar Land Rover Automotive PLC 5,875 % fällig am 15.11.2024	€	1.000		1.012
Santander UK Group Holdings PLC 6,750 % fällig am 24.06.2024	£	800		934
Wynn Resorts Finance LLC 5,125 % fällig am 01.10.2029	$	1.000		915
WP/AP Telecom Holdings BV 7,498 % fällig am 30.03.2029	€	800		864
Petroleos Mexicanos 7,690 % fällig am 23.01.2050	$	1.200		853

(a) Der Diversified Income Duration Hedged Fund legt in Anteile eines verbundenen Fonds an.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Fondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

BESCHREIBUNG		AKTIEN		KOSTEN (000S)
KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2023				
PIMCO Funds: Global Investors Series plc - Emerging Markets Bond ESG Fund (a)		426.683	$	4.337
PIMCO Funds: Global Investors Series plc - Global Investment Grade Credit ESG Fund (a)		147.887		1.485
		PAR (000S)		
Uniform Mortgage-Backed Security 5,000 % fällig am 01.04.2053	$	1.000		993
Uniform Mortgage-Backed Security 5,500 % fällig am 01.05.2053		912		919
Uruguay Government International Bond 5,100 % fällig am 18.06.2050		700		720
Panama Government International Bond 6,700 % fällig am 26.01.2036		600		648
Bank of America Corp. 6,204 % fällig am 10.11.2028		600		627
Dominican Republic Government International Bond 4,500 % fällig am 30.01.2030		600		530
Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia 4,700 % fällig am 06.06.2032		500		509
JPMorgan Chase & Co. 2,580 % fällig am 22.04.2032		600		504
Sprint Capital Corp. 8,750 % fällig am 15.03.2032		400		492
Colombia Government International Bond 7,500 % fällig am 02.02.2034		500		487
Mexico Government International Bond 4,875 % fällig am 19.05.2033		500		485
Peru Government International Bond 3,000 % fällig am 15.01.2034		500		418
Amgen, Inc. 3,000 % fällig am 22.02.2029		450		417
WMG Acquisition Corp. 2,250 % fällig am 15.08.2031	€	400		345
Southern California Edison Co. 2,500 % fällig am 01.06.2031	$	400		343
SBA Communications Corp. 3,125 % fällig am 01.02.2029		400		342
Air Canada Pass-Through Trust 5,250 % fällig am 01.10.2030		343		335
IQVIA, Inc. 2,250 % fällig am 15.01.2028	€	350		334

BESCHREIBUNG		AKTIEN		ERLÖSE (000S)
VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2023				
PIMCO Funds: Global Investors Series plc - Emerging Markets Bond ESG Fund (a)		81.957	$	833
		PAR (000S)		
BNP Paribas S.A. 1,675 % fällig am 30.06.2027	$	400		355
Uruguay Government International Bond 5,100 % fällig am 18.06.2050		300		306
KBC Group NV 5,796 % fällig am 19.01.2029		300		301
Dominican Republic Government International Bond 4,500 % fällig am 30.01.2030		300		265
Peru Government International Bond 3,000 % fällig am 15.01.2034		300		250
Brazil Government International Bond 4,750 % fällig am 14.01.2050		300		219
Panama Government International Bond 4,500 % fällig am 19.01.2063		300		219
Oman Government International Bond 6,000 % fällig am 01.08.2029		200		206
Oman Government International Bond 6,750 % fällig am 17.01.2048		200		199
Mexico Government International Bond 5,750 % fällig am 12.10.2110		225		198
Colombia Government International Bond 7,500 % fällig am 02.02.2034		200		190
Ivory Coast Government International Bond 6,125 % fällig am 15.06.2033		200		180
Natura Cosmeticos S.A. 4,125 % fällig am 03.05.2028		200		162
Chile Government International Bond 3,100 % fällig am 07.05.2041		200		153
Morocco Government International Bond 4,000 % fällig am 15.12.2050		200		138
MPT Operating Partnership LP 3,500 % fällig am 15.03.2031		200		137
ReNew Power Pvt Ltd. 5,875 % fällig am 05.03.2027		125		119
Argentina Government International Bond 1,500 % fällig am 09.07.2035		500		112
TDC Net A/S 5,056 % fällig am 31.05.2028	€	100		108
Bellis Acquisition Co. PLC 3,250 % fällig am 16.02.2026	£	100		101
ING Groep NV 1,125 % fällig am 07.12.2028		100		99
Verallia S.A. 1,625 % fällig am 14.05.2028	€	100		97
IQVIA, Inc. 2,250 % fällig am 15.01.2028		100		95
Wabtec Transportation Netherlands BV 1,250 % fällig am 03.12.2027		100		94
Avolon Holdings Funding Ltd. 2,875 % fällig am 15.02.2025	$	100		93
HSBC Holdings PLC 3,973 % fällig am 22.05.2030		100		92
G City Europe Ltd. 4,250 % fällig am 11.09.2025	€	100		92
Altice Financing S.A. 4,250 % fällig am 15.08.2029		100		91
Banco BTG Pactual S.A. 2,750 % fällig am 11.01.2026	$	100		91
Dominican Republic Government International Bond 6,500 % fällig am 15.02.2048		100		89
Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc. 2,472 % fällig am 14.01.2029		100		87
Dana, Inc. 4,250 % fällig am 01.09.2030		100		84
Ivory Coast Government International Bond 6,625 % fällig am 22.03.2048	€	100		80
Colombia Government International Bond 5,000 % fällig am 15.06.2045	$	100		71
Microsoft Corp. 2,675 % fällig am 01.06.2060		100		70

(a) Der Diversified Income ESG Fund legt in Anteile eines verbundenen Fonds an.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Fondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des Dynamic Bond Fund

BESCHREIBUNG		AKTIEN		KOSTEN (000S)
KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2023				
PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)		6.757.953	$	67.295
		PAR (000S)		
Hungary Treasury Bills 0,000 % fällig am 20.04.2023	HUF	12.975.000		37.913
Hungary Treasury Bills 0,000 % fällig am 13.04.2023		12.927.000		37.254
Toronto-Dominion Bank 3,879 % fällig am 13.03.2026	€	23.400		24.989
Stratton Mortgage Funding PLC 5,991 % fällig am 20.07.2060	£	10.705		11.546
Caesars Entertainment Corp. 8,452 % fällig am 06.02.2030	$	7.000		6.930
Banca Monte dei Paschi di Siena SpA 6,750 % fällig am 02.03.2026	€	6.500		6.888
DISH Network Corp. 11,750 % fällig am 15.11.2027	$	6.400		6.528
Venture Global Calcasieu Pass LLC 6,250 % fällig am 15.01.2030		4.800		4.800
Adani Ports & Special Economic Zone Ltd. 3,375 % fällig am 24.07.2024		5.000		4.625
Resloc UK PLC 3,776 % fällig am 15.12.2043	€	4.756		4.139
HSBC Holdings PLC 6,254 % fällig am 09.03.2034	$	3.800		3.800
Pacific Gas & Electric Co. 6,150 % fällig am 15.01.2033		3.800		3.790
Mexico Government International Bond 6,350 % fällig am 09.02.2035		3.700		3.686
Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd. 3,629 % fällig am 06.04.2026	€	3.300		3.574
Adani Ports & Special Economic Zone Ltd. 3,100 % fällig am 02.02.2031	$	5.000		3.400
Adler Financing SARL 12,500 % fällig am 30.06.2025	€	2.989		3.057
Trinity Square PLC 5,316 % fällig am 15.07.2059	£	2.153		2.608
Canada Square Funding PLC 5,316 % fällig am 17.01.2059		2.380		2.574
Towd Point Mortgage Funding PLC 5,841 % fällig am 20.07.2045		2.049		2.481

BESCHREIBUNG		AKTIEN		ERLÖSE (000S)
VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2023				
PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)		8.234.342	$	82.000
		PAR (000S)		
Caesars Entertainment Corp. 8,452 % fällig am 06.02.2030	$	5.500		5.486
Zayo Group Holdings, Inc. 8,217 % fällig am 09.03.2027		6.204		5.028
Bank of America Corp. 4,125 % fällig am 22.01.2024		5.050		4.993
		AKTIEN		
Nationwide Building Society		31.186		4.794
		PAR (000S)		
U.S. Foods, Inc. 7,943 % fällig am 22.11.2028	$	4.021		4.016
Volkswagen Financial Services NV 1,125 % fällig am 18.09.2023	£	3.300		3.829
Israel Government International Bond 2,750 % fällig am 03.07.2030	$	4.000		3.640
Israel Government International Bond 3,800 % fällig am 13.05.2060		4.600		3.611
Peru Government International Bond 5,940 % fällig am 12.02.2029	PEN	12.900		3.105
Hamburg Commercial Bank AG 0,500 % fällig am 22.09.2026	€	2.800		2.720
Organon & Co. 8,250 % fällig am 02.06.2028	$	2.543		2.536
Morgan Stanley 3,875 % fällig am 29.04.2024		2.575		2.530
Imperial Brands Finance PLC 2,125 % fällig am 12.02.2027	€	2.500		2.529
HSBC Holdings PLC 3,356 % fällig am 18.05.2024	$	2.300		2.303
MPT Operating Partnership LP 2,500 % fällig am 24.03.2026	£	2.500		2.227
Zayo Group Holdings, Inc. 1,000 % fällig am 09.03.2027	€	1.940		1.775
Hilton Grand Vacations Borrower LLC 8,239 % fällig am 02.08.2028	$	1.576		1.570
Goldman Sachs Group, Inc. 3,000 % fällig am 15.03.2024		1.500		1.461
Adient U.S. LLC 8,334 % fällig am 10.04.2028		1.016		1.016

(a) Der Dynamic Bond Fund legt in Anteile eines verbundenen Fonds an.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Fondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

BESCHREIBUNG		PAR (000S)		KOSTEN (000S)
KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2023				
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,625 % fällig am 15.07.2032 (b)	$	596.057	€	521.863
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 1,625 % fällig am 15.10.2027 (b)		187.147		176.014
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 1,125 % fällig am 15.01.2033 (b)		179.512		164.394
France Government International Bond 4,250 % fällig am 25.10.2023	€	117.260		117.530
France Treasury Bills 0,000 % fällig am 16.03.2022		47.000		47.008
France Government International Bond 1,750 % fällig am 25.05.2023		45.430		45.337
Japan Treasury Bills 0,000 % fällig am 11.09.2023	¥	5.000.000		33.366
France Treasury Bills 0,000 % fällig am 29.03.2023	€	32.400		32.248
Tower Bridge Funding PLC 5,991 % fällig am 20.10.2064	£	26.200		29.919
Italy Government International Bond 0,000 % fällig am 31.03.2023	€	29.400		29.242
CVS Health Corp. 5,000 % fällig am 20.02.2026	$	29.300		27.240
London Wall Mortgage Capital PLC 5,452 % fällig am 15.05.2051	£	24.207		27.022
Romania Government International Bond 5,000 % fällig am 27.09.2026	€	26.000		26.188
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 4,500 % fällig am 01.05.2023		20.000		20.093
France Government International Bond 0,000 % fällig am 25.03.2023		19.700		19.652
		AKTIEN		
Siemens Energy AG		883.100		16.236
		PAR (000S)		
SK Hynix, Inc. 6,250 % fällig am 17.01.2026	$	16.200		15.043
Export Development Canada 4,000 % fällig am 19.02.2026	£	12.500		14.080
State Street Corp. 4,857 % fällig am 26.01.2026	$	15.200		13.990
Union Pacific Corp. 4,750 % fällig am 21.02.2026		14.600		13.611

BESCHREIBUNG		PAR (000S)		ERLÖSE (000S)
VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2023				
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,625 % fällig am 15.07.2032 (b)	$	129.728	€	112.978
		AKTIEN		
PIMCO ETFs plc - PIMCO Euro Short Maturity UCITS ETF (a)		930.100		90.255
Vertex Pharmaceuticals, Inc.		192.000		60.007
		PAR (000S)		
Italy Government International Bond 0,000 % fällig am 31.03.2023	€	56.400		56.206
		AKTIEN		
Regeneron Pharmaceuticals, Inc.		60.700		42.844
Humana, Inc.		92.270		41.597
Taiwan Semiconductor Manufacturing Co. Ltd.		2.411.000		40.099
Lam Research Corp.		71.670		37.689
Elevance Health, Inc.		85.930		36.114
Exxon Mobil Corp.		365.700		35.538
Applied Materials, Inc.		291.300		34.744
NetApp, Inc.		529.300		33.923
		PAR (000S)		
France Treasury Bills 0,000 % fällig am 29.03.2023	€	32.400		32.260
		AKTIEN		
Samsung Electronics Co. Ltd.		625.600		30.606
Micron Technology, Inc.		431.200		27.811
Shin-Etsu Chemical Co. Ltd.		222.460		26.507
Incyte Corp.		456.300		25.883
Tokyo Electron Ltd.		82.670		25.733
Hologic, Inc.		331.200		24.970
Teradyne, Inc.		256.700		24.869
Ambarella, Inc.		308.000		23.187
Marvell Technology, Inc.		388.800		22.531
Ibiden Co Ltd.		426.700		21.433
BYD Co. Ltd. 'H'		766.000		21.431
Advantest Corp.		323.200		20.131
		PAR (000S)		
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 4,500 % fällig am 01.05.2023	€	20.000		20.070
		AKTIEN		
Exelixis, Inc.		1.135.300		19.959
Aptiv PLC		214.100		19.845
United Therapeutics Corp.		94.600		19.699
United Microelectronics Corp.		12.406.000		19.037
Mitsubishi Electric Corp.		2.025.370		18.648
Nitto Denko Corp.		332.800		18.471

(a) Der Dynamic Multi-Asset Fund legt in Anteile eines verbundenen Fonds an.

(b) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Fondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

BESCHREIBUNG	AKTIEN	KOSTEN (000S)
KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2023		
		$
PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	105.350.625	1.049.012
	PAR (000S)	
Thailand Government International Bond 2,350 % fällig am 17.06.2026	THB 3.247.762	95.107
Thailand Government International Bond 3,350 % fällig am 17.06.2033	2.281.608	71.967
Thailand Government International Bond 2,650 % fällig am 17.06.2028	2.263.201	67.815
Bonos de la Tesoreria de la Republica en Pesos 6,000 % fällig am 01.04.2033	CLP 46.955.000	60.421
Mexico Government International Bond 5,000 % fällig am 06.03.2025	MXN 1.173.200	56.775
South Africa Government International Bond 10,500 % fällig am 21.12.2026	ZAR 962.000	55.705
Peru Government International Bond 7,300 % fällig am 12.08.2033	PEN 194.300	52.760
Malaysia Government Investment Issue 4,369 % fällig am 31.10.2028	MYR 217.968	51.095
Hungary Treasury Bills 0,000 % fällig am 20.04.2023	HUF 16.383.000	47.871
Hungary Treasury Bills 0,000 % fällig am 13.04.2023	16.323.000	47.041
China Government International Bond 2,620 % fällig am 25.09.2029	CNY 308.300	42.982
Peru Government International Bond 8,200 % fällig am 12.08.2026	PEN 150.200	41.761
Colombian TES 13,250 % fällig am 09.02.2033	COP 187.473.900	40.527
Malaysia Government International Bond 3,800 % fällig am 17.08.2023	MYR 176.400	37.834
Indonesia Government International Bond 7,500 % fällig am 15.06.2035	IDR 483.620.000	34.175
Hungary Government International Bond 6,750 % fällig am 22.10.2028	HUF 11.684.600	29.879
Mexico Government International Bond 5,500 % fällig am 04.03.2027	MXN 616.000	29.103
China Government International Bond 2,600 % fällig am 01.09.2032	CNY 201.010	27.869
Zentralbanknoten der Dominikanischen Republik 13,000 % fällig am 05.12.2025	DOP 1.634.500	27.039

BESCHREIBUNG	AKTIEN	ERLÖSE (000S)
VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2023		
		$
PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	91.645.49	912
	PAR (000S)	
Thailand Government International Bond 3,350 % fällig am 17.06.2033	THB 2.212.958	68
Mexico Government International Bond 5,000 % fällig am 06.03.2025	MXN 1.173.200	61
Malaysia Government Investment Issue 3,990 % fällig am 15.10.2025	MYR 267.690	61
Indonesia Government International Bond 7,000 % fällig am 15.02.2033	IDR 681.081.000	47
Romania Government International Bond 4,500 % fällig am 17.06.2024	RON 212.500	45
Thailand Government International Bond 3,390 % fällig am 17.06.2037	THB 1.344.200	42
Thailand Government International Bond 2,350 % fällig am 17.06.2026	1.376.638	40
China Government International Bond 3,030 % fällig am 11.03.2026	CNY 245.690	35
Colombian TES 9,250 % fällig am 28.05.2042	COP 179.039.600	31
Colombian TES 13,250 % fällig am 09.02.2033	113.676.500	27
Colombian TES 3,750 % fällig am 25.02.2037	122.979.368	22
South Africa Government International Bond 6,500 % fällig am 28.02.2041	ZAR 607.449	20
South Africa Government International Bond 8,000 % fällig am 31.01.2030	399.900	20
Colombian TES 2,250 % fällig am 18.04.2029	COP 98.665.684	20
Indonesia Government International Bond 7,500 % fällig am 15.06.2035	IDR 246.840.000	18
Indonesia Government International Bond 7,125 % fällig am 15.06.2038	237.219.000	15
Thailand Government International Bond 2,000 % fällig am 17.12.2031	THB 508.070	14
Malaysia Government International Bond 3,757 % fällig am 22.05.2040	MYR 64.468	13
China Government Bond 2,700 % fällig am 03.11.2026	CNY 96.600	13

(a) Der Emerging Local Bond Fund legt in Anteile eines verbundenen Fonds an.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Fondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

BESCHREIBUNG		PAR (000S)	KOSTEN (000S)
KÄUFE BIS ZUM 30. Juni JUNI 2023			
Thailand Government International Bond 2,350 % fällig am 17.06.2026	THB	10.109	$ 296
Peru Government International Bond 7,300 % fällig am 12.08.2033	PEN	950	262
Poland Government International Bond 7,500 % fällig am 25.07.2028	PLN	800	198
Thailand Government International Bond 2,650 % fällig am 17.06.2028	THB	5.419	163
International Finance Corp. 8,000 % fällig am 09.10.2023	IDR	2.200.000	148
Peru Government International Bond 8,200 % fällig am 12.08.2026	PEN	500	138
Mexico Government International Bond 7,500 % fällig am 26.05.2033	MXN	2.800	131
Bonos de la Tesoreria de la Republica en Pesos 6,000 % fällig am 01.04.2033	CLP	100.000	129
Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 5,800 % fällig am 19.01.2028	ZAR	2.500	125
Poland Government International Bond 6,000 % fällig am 25.10.2033	PLN	500	115
Japan Treasury Bills 0,000 % fällig am 17.04.2023	¥	14.000	110
Malaysia Government International Bond 3,800 % fällig am 17.08.2023	MYR	500	107
Czech Republic Government International Bond 5,000 % fällig am 30.09.2030	CZK	2.200	105
International Bank for Reconstruction & Development 8,500 % fällig am 06.04.2026	MXN	2.000	100
Indonesia Government International Bond 6,375 % fällig am 15.04.2032	IDR	1.467.000	99
Europäische Investitionsbank 2,875 % fällig am 15.11.2029	PLN	500	98
South Africa Government International Bond 10,500 % fällig am 21.12.2026	ZAR	1.700	93
Europäische Investitionsbank 3,000 % fällig am 25.11.2029	PLN	500	91
Zentralbanknoten der Dominikanischen Republik 13,000 % fällig am 05.12.2025	DOP	5.300	88
Thailand Government International Bond 3,350 % fällig am 17.06.2033	THB	2.642	84
International Bank for Reconstruction & Development 7,070 % fällig am 26.06.2029	MXN	1.400	70
Asian Development Bank 12,750 % fällig am 03.03.2025	COP	339.000	68
Thailand Government International Bond 3,400 % fällig am 17.06.2036	THB	2.001	65
Malaysia Government Investment Issue 4,193 % fällig am 07.10.2032	MYR	278	64
Colombian TES 3,750 % fällig am 25.02.2037	COP	363.205	63
South Africa Government International Bond 9,000 % fällig am 31.01.2040	ZAR	1.400	61
Hungary Government International Bond 6,750 % fällig am 22.10.2028	HUF	22.800	60
South Africa Government International Bond 8,750 % fällig am 31.01.2044	ZAR	1.400	59
Colombian TES 9,250 % fällig am 28.05.2042	COP	313.000	51
Malaysia Government Investment Issue 3,465 % fällig am 15.10.2030	MYR	230	51
Peru Government International Bond 5,400 % fällig am 12.08.2034	PEN	200	48
Thailand Government International Bond 2,000 % fällig am 17.12.2031	THB	1.520	45
Dominican Republic Government International Bond 13,625 % fällig am 10.02.2034	DOP	2.000	44
Malaysia Government International Bond 2,632 % fällig am 15.04.2031	MYR	210	44

BESCHREIBUNG		PAR (000S)	ERLÖSE (000S)
VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2023			
South Africa Government International Bond 10,500 % fällig am 21.12.2026	ZAR	2.900	$ 178
Romania Government International Bond 3,250 % fällig am 29.04.2024	RON	800	171
Israel Treasury Bills 0,000 % fällig am 08.02.2023	ILS	500	148
Israel Government International Bond 0,150 % fällig am 31.07.2023		500	136
Thailand Government International Bond 3,390 % fällig am 17.06.2037	THB	3.900	125
Poland Government International Bond 7,500 % fällig am 25.07.2028	PLN	500	119
South Africa Government International Bond 6,500 % fällig am 28.02.2041	ZAR	3.300	112
Japan Treasury Bills 0,000 % fällig am 17.04.2023	¥	14.000	108
Europäische Investitionsbank 3,000 % fällig am 25.11.2029	PLN	500	99
Thailand Government International Bond 3,350 % fällig am 17.06.2033	THB	2.510	80
Thailand Government International Bond 2,350 % fällig am 17.06.2026		2.690	79
Thailand Government International Bond 1,585 % fällig am 17.12.2035		2.920	73
Malaysia Government International Bond 3,582 % fällig am 15.07.2032	MYR	320	70
Colombian TES 3,750 % fällig am 25.02.2037	COP	366.443	69
Indonesia Government International Bond 7,000 % fällig am 15.02.2033	IDR	974.000	67
Colombian TES 9,250 % fällig am 28.05.2042	COP	313.000	55
Peru Government International Bond 6,900 % fällig am 12.08.2037	PEN	200	50
Zentralbanknoten der Dominikanischen Republik 13,000 % fällig am 30.01.2026	DOP	2.500	47
Malaysia Government Investment Issue 4,369 % fällig am 31.10.2028	MYR	198	47
South Africa Government International Bond 10,500 % fällig am 21.12.2026	ZAR	700	42
Indonesia Government International Bond 6,375 % fällig am 15.04.2042	IDR	610.000	40
Malaysia Government International Bond 3,757 % fällig am 22.05.2040	MYR	188	40
Colombian TES 2,250 % fällig am 18.04.2029	COP	169.408	34
Thailand Government International Bond 2,650 % fällig am 17.06.2028	THB	1.070	32
Zentralbanknoten der Dominikanischen Republik 13,000 % fällig am 05.12.2025	DOP	1.700	32
Hungary Government International Bond 5,000 % fällig am 22.02.2027	€	30	32
Malaysia Government International Bond 4,696 % fällig am 15.10.2042	MYR	134	32
Indonesia Government International Bond 7,500 % fällig am 15.06.2035	IDR	388.000	28
Malaysia Government Investment Issue 3,990 % fällig am 15.10.2025	MYR	120	27
Israel Government International Bond 1,500 % fällig am 30.11.2023	ILS	100	27

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Fondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

BESCHREIBUNG		AKTIEN		KOSTEN (000S)
KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2023				
PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)		85.561.931	$	852.006
		PAR (000S)		
U.S. Treasury Notes 4,000 % fällig am 28.02.2030	$	33.100		32.946
South Africa Government International Bond 10,500 % fällig am 21.12.2026	ZAR	484.900		28.930
Saudi Arabia Government International Bond 4,875 % fällig am 18.07.2033	$	28.400		28.065
Saudi Arabia Government International Bond 4,750 % fällig am 18.01.2028		27.600		27.504
Malaysia Government International Bond 3,800 % fällig am 17.08.2023	MYR	107.200		22.992
CBB International Sukuk Programme Co. 6,250 % fällig am 18.10.2030	$	21.000		21.000
Mexico Government International Bond 6,350 % fällig am 09.02.2035		16.400		16.340
Nigeria Government International Bond 6,500 % fällig am 28.11.2027		18.844		15.749
Hungarian Development Bank 6,500 % fällig am 29.06.2028		15.300		15.131
Ecopetrol S.A. 0,000 % fällig am 17.08.2024		15.200		14.668
Peru Government International Bond 6,550 % fällig am 14.03.2037		13.300		14.614
Gaci First Investment Co. 5,125 % fällig am 14.02.2053		15.600		14.553
Nogaholding Sukuk Ltd. 6,625 % fällig am 25.05.2033		13.900		13.900
Zentralbanknoten der Dominikanischen Republik 13,000 % fällig am 05.12.2025	DOP	833.500		13.779
Poland Government International Bond 4,875 % fällig am 04.10.2033	$	13.400		13.327
Turkey Government International Bond 9,125 % fällig am 13.07.2030		12.000		11.894
Israel Government International Bond 1,500 % fällig am 30.11.2023	ILS	41.700		11.583
Dominican Republic Government International Bond 13,625 % fällig am 03.02.2033	DOP	631.800		11.158
Dominican Republic Government International Bond 13,625 % fällig am 10.02.2034		489.000		10.813

BESCHREIBUNG		AKTIEN		ERLÖSE (000S)
VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2023				
PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)		87.959.244	$	875.900
		PAR (000S)		
CBB International Sukuk Programme Co. 6,250 % fällig am 18.10.2030	$	21.000		21.171
Egypt Government International Bond 4,750 % fällig am 16.04.2026	€	14.508		13.585
Chile Government International Bond 2,750 % fällig am 31.01.2027	$	13.400		12.720
Standard Chartered PLC 7,767 % fällig am 16.11.2028		11.200		11.943
Colombia Government International Bond 4,000 % fällig am 26.02.2024		12.100		11.933
Nigeria Government International Bond 6,500 % fällig am 28.11.2027		13.000		11.306
Nogaholding Sukuk Ltd. 6,625 % fällig am 25.05.2033		10.200		10.216
Serbia Government International Bond 6,250 % fällig am 26.05.2028		9.950		9.883
Indonesia Government International Bond 4,850 % fällig am 11.01.2033		9.700		9.754
Hungary Government International Bond 5,000 % fällig am 22.02.2027	€	8.200		8.829
CK Hutchison International Ltd. 4,750 % fällig am 21.04.2028	$	8.800		8.828
Mexico Government International Bond 4,280 % fällig am 14.08.2041		10.491		8.685
Ivory Coast Government International Bond 5,750 % fällig am 31.12.2032		9.347		8.589
CK Hutchison International Ltd. 4,875 % fällig am 21.04.2033		8.400		8.432
Morocco Government International Bond 6,500 % fällig am 08.09.2033		7.600		7.916
Gaci First Investment Co. 5,375 % fällig am 13.10.2122		8.000		7.731
South Africa Government International Bond 4,850 % fällig am 30.09.2029		8.500		7.719
Hungary Government International Bond 6,750 % fällig am 25.09.2052		7.300		7.486
Petroleos Mexicanos 6,950 % fällig am 28.01.2060		9.800		6.630

(a) Der Emerging Markets Bond Fund legt in Anteile eines verbundenen Fonds an.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Fondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

BESCHREIBUNG		PAR (000S)		KOSTEN (000S)
KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2023				
South Africa Government International Bond 10,500 % fällig am 21.12.2026	ZAR	324.500	$	19.365
Israel Government International Bond 1,500 % fällig am 30.11.2023	ILS	62.400		17.333
Malaysia Government International Bond 3,800 % fällig am 17.08.2023	MYR	74.400		15.957
Hungary Government International Bond 6,750 % fällig am 25.09.2052	$	16.600		15.891
Mexico Government International Bond 4,875 % fällig am 19.05.2033		15.800		15.097
Poland Government International Bond 4,875 % fällig am 04.10.2033		14.700		14.609
Mexico Government International Bond 6,350 % fällig am 09.02.2035		14.000		13.948
Israel Government International Bond 4,500 % fällig am 17.01.2033		13.400		13.322
Colombia Government International Bond 7,500 % fällig am 02.02.2034		12.510		12.418
OTP Bank Nyrt 8,750 % fällig am 15.05.2033		12.300		12.228
Finanzministerium der Regierung von Schardscha 6,500 % fällig am 23.11.2032		12.300		12.199
Uruguay Government International Bond 5,750 % fällig am 28.10.2034		11.200		12.168
Poland Government International Bond 5,500 % fällig am 04.04.2053		11.500		11.359
Zentralbanknoten der Dominikanischen Republik 13,000 % fällig am 05.12.2025	DOP	685.100		11.321
Romania Government International Bond 7,625 % fällig am 17.01.2053	$	11.100		11.040
Bulgaria Government International Bond 4,500 % fällig am 27.01.2033	€	10.400		10.988
Serbia Government International Bond 6,250 % fällig am 26.05.2028	$	10.950		10.909
Hungarian Development Bank 6,500 % fällig am 29.06.2028		10.900		10.780
Philippines Government International Bond 5,500 % fällig am 17.01.2048		10.600		10.588
Serbia Government International Bond 6,500 % fällig am 26.09.2033		10.500		10.274
IHS Netherlands Holdco BV 8,000 % fällig am 18.09.2027		10.700		9.658
Poland Government International Bond 2,750 % fällig am 25.05.2032	€	9.100		8.906
Dominican Republic Government International Bond 13,625 % fällig am 03.02.2033	DOP	500.900		8.847
Mexico Government International Bond 5,400 % fällig am 09.02.2028	$	8.700		8.683
Export-Import Bank of Korea 5,125 % fällig am 11.01.2033		8.400		8.366
Romania Government International Bond 2,000 % fällig am 14.04.2033	€	11.300		8.340
Jordan Government International Bond 7,500 % fällig am 13.01.2029	$	8.000		7.904
Magyar Export-Import Bank 6,125 % fällig am 04.12.2027		7.500		7.443
Indonesia Government International Bond 4,850 % fällig am 11.01.2033		7.400		7.257
Airport Authority Hong Kong 4,875 % fällig am 12.01.2030		7.200		7.155
North Macedonia Government International Bond 6,960 % fällig am 13.03.2027	€	6.700		7.085
Bank Gospodarstwa Krajowego 5,375 % fällig am 22.05.2033	$	7.000		6.983
First Abu Dhabi Bank PJSC 4,774 % fällig am 06.06.2028		6.500		6.500
Polaris PLC 6,141 % fällig am 23.05.2059	£	5.307		6.480
North Macedonia Government International Bond 5,625 % fällig am 26.07.2023	€	5.800		6.197
Hong Kong Government International Bond 4,625 % fällig am 11.01.2033	$	6.200		6.177
Dominican Republic Government International Bond 13,625 % fällig am 10.02.2034	DOP	277.400		6.130
Costa Rica Government International Bond 6,550 % fällig am 03.04.2034	$	6.000		6.000
Morocco Government International Bond 6,500 % fällig am 08.09.2033		5.900		5.855
Hong Kong Government International Bond 3,750 % fällig am 07.06.2032	€	5.500		5.821
Khazanah Global Sukuk Bhd. 4,687 % fällig am 01.06.2028	$	5.800		5.800
Corp. Nacional del Cobre de Chile 5,125 % fällig am 02.02.2033		5.800		5.796
Hong Kong Government International Bond 4,500 % fällig am 11.01.2028		5.800		5.778

BESCHREIBUNG		PAR (000S)		ERLÖSE (000S)
VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2023				
Israel Government International Bond 1,500 % fällig am 30.11.2023	ILS	152.300	$	40.645
Israel Government International Bond 0,150 % fällig am 31.07.2023		79.600		21.341
Mexico Government International Bond 6,350 % fällig am 09.02.2035	$	14.000		14.659
South Africa Government International Bond 4,300 % fällig am 12.10.2028		14.500		13.268
Israel Government International Bond 4,500 % fällig am 17.01.2033		13.400		13.224
South Africa Government International Bond 5,875 % fällig am 20.04.2032		13.500		12.538
Chile Government International Bond 2,750 % fällig am 31.01.2027		12.900		12.245
OTP Bank Nyrt 8,750 % fällig am 15.05.2033		12.300		12.194
Hungary Government International Bond 5,000 % fällig am 22.02.2027	€	10.600		11.416
Serbia Government International Bond 6,250 % fällig am 26.05.2028	$	10.950		10.915
Sociedad Quimica y Minera de Chile S.A. 3,500 % fällig am 10.09.2051		13.700		9.575
Colombia Government International Bond 6,125 % fällig am 18.01.2041		11.400		8.922
Poland Government International Bond 2,750 % fällig am 25.05.2032	€	9.100		8.888
Mexico Government International Bond 5,400 % fällig am 09.02.2028	$	8.700		8.829
Israel Government International Bond 4,250 % fällig am 31.03.2023	ILS	30.500		8.658
Uruguay Government International Bond 7,875 % fällig am 15.01.2033	$	6.930		8.532
Egypt Government International Bond 5,250 % fällig am 06.10.2025		10.600		8.431
Ivory Coast Government International Bond 5,750 % fällig am 31.12.2032		8.942		8.222
Standard Chartered PLC 7,767 % fällig am 16.11.2028		7.600		8.104
Eastern & Southern African Trade & Development Bank 4,125 % fällig am 30.06.2028		9.900		7.884
Indonesia Government International Bond 4,850 % fällig am 11.01.2033		7.400		7.439
Banco do Brasil S.A. 3,250 % fällig am 30.09.2026		8.100		7.341
Mongolia Government International Bond 3,500 % fällig am 07.07.2027		8.600		7.046
Qatar Government International Bond 3,250 % fällig am 02.06.2026		7.000		6.759
Natura Cosmeticos S.A. 4,125 % fällig am 03.05.2028		8.100		6.510
Philippines Government International Bond 3,200 % fällig am 06.07.2046		8.700		6.430
XP, Inc. 3,250 % fällig am 01.07.2026		7.400		6.377
Hong Kong Government International Bond 4,625 % fällig am 11.01.2033		6.200		6.319
Greenko Dutch BV 3,850 % fällig am 29.03.2026		6.956		6.266
Morocco Government International Bond 6,500 % fällig am 08.09.2033		5.900		5.922
Hong Kong Government International Bond 4,500 % fällig am 11.01.2028		5.800		5.834
Mexico Government International Bond 3,771 % fällig am 24.05.2061		8.200		5.520
Poland Government International Bond 5,500 % fällig am 16.11.2027		5.100		5.278

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Fondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

BESCHREIBUNG		AKTIEN		KOSTEN (000S)
KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2023				
PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)		3.481.150	$	34.663
		PAR (000S)		
Japan Treasury Bills 0,000 % fällig am 17.04.2023	¥	430.000		3.373
Bank Leumi Le-Israel B.M. 7,129 % fällig am 18.07.2033	$	2.200		2.200
Colombia Government International Bond 7,500 % fällig am 02.02.2034		1.500		1.489
KazMunayGas National Co. JSC 6,375 % fällig am 24.10.2048		1.500		1.277
Bank Hapoalim B.M. 3,255 % fällig am 21.01.2032		1.300		1.153
Seazen Group Ltd. 4,450 % fällig am 13.07.2025		1.400		1.132
Abu Dhabi National Energy Co. PJSC 4,375 % fällig am 24.01.2029		1.100		1.093
Ecopetrol S.A. 0,000 % fällig am 17.08.2024		1.000		965
ONGC Videsh Vankorneft Pte. Ltd. 3,750 % fällig am 27.07.2026		1.000		954
NBK SPC Ltd. 1,625 % fällig am 15.09.2027		800		714
SK on Co. Ltd. 5,375 % fällig am 11.05.2026		700		699
Abu Dhabi Commercial Bank PJSC 3,500 % fällig am 31.03.2027		700		665
Melco Resorts Finance Ltd. 5,625 % fällig am 17.07.2027		700		641
Sunny Optical Technology Group Co. Ltd. 5,950 % fällig am 17.07.2026		600		599
POSCO 5,750 % fällig am 17.01.2028		600		597
Standard Chartered PLC 7,767 % fällig am 16.11.2028		500		547
Kasikornbank PCL 3,343 % fällig am 02.10.2031		600		532
Greensaif Pipelines Bidco SARL 6,129 % fällig am 23.02.2038		500		500
Sasol Financing USA LLC 8,750 % fällig am 03.05.2029		500		500

BESCHREIBUNG		AKTIEN		ERLÖSE (000S)
VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2023				
PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)		3.561.054	$	35.460
		PAR (000S)		
Israel Government International Bond 1,500 % fällig am 30.11.2023	ILS	6.000		1.650
Bank Leumi Le-Israel B.M. 3,275 % fällig am 29.01.2031	$	1.800		1.631
QNB Finance Ltd. 3,500 % fällig am 28.03.2024		1.548		1.524
Colombia Government International Bond 7,500 % fällig am 02.02.2034		1.500		1.433
Mizrahi Tefahot Bank Ltd. 3,077 % fällig am 07.04.2031		1.300		1.167
New Metro Global Ltd. 6,800 % fällig am 05.08.2023		1.100		1.055
Rio Oil Finance Trust 8,200 % fällig am 06.04.2028		968		973
ABJA Investment Co. Pte. Ltd. 5,450 % fällig am 24.01.2028		1.000		962
Bank Hapoalim B.M. 3,255 % fällig am 21.01.2032		1.100		923
Bank Leumi Le-Israel B.M. 7,129 % fällig am 18.07.2033		900		872
S.A. Global Sukuk Ltd. 2,694 % fällig am 17.06.2031		1.000		871
Israel Electric Corp. Ltd. 3,750 % fällig am 22.02.2032		1.000		871
Israel Government International Bond 0,150 % fällig am 31.07.2023	ILS	2.700		752
Xiaomi Best Time International Ltd. 2,875 % fällig am 14.07.2031	$	900		684
Bangkok Bank PCL 3,733 % fällig am 25.09.2034		800		678
POSCO 5,750 % fällig am 17.01.2028		600		618
Leviathan Bond Ltd. 6,125 % fällig am 30.06.2025		600		578
Banco de Credito e Inversiones S.A. 3,500 % fällig am 12.10.2027		600		550
Studio City Finance Ltd. 6,500 % fällig am 15.01.2028		600		510

(a) Der Emerging Markets Corporate Bond Fund legt in Anteile eines verbundenen Fonds an.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Fondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

BESCHREIBUNG		AKTIEN		KOSTEN (000S)
KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2023				
PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)		11.259.245	$	112.116
		PAR (000S)		
Peru Government International Bond 7,300 % fällig am 12.08.2033	PEN	33.800		9.363
Mexico Government International Bond 5,000 % fällig am 06.03.2025	MXN	182.400		8.782
Bonos de la Tesoreria de la Republica en Pesos 6,000 % fällig am 01.04.2033	CLP	6.390.000		8.227
U.S. Treasury Bonds 1,125 % fällig am 15.05.2040	$	11.900		7.961
South Africa Government International Bond 10,500 % fällig am 21.12.2026	ZAR	134.500		7.474
Poland Government International Bond 0,250 % fällig am 25.10.2026	PLN	33.200		5.997
Saudi Arabia Government International Bond 4,875 % fällig am 18.07.2033	$	5.200		5.139
Zentralbanknoten der Dominikanischen Republik 13,000 % fällig am 05.12.2025	DOP	269.700		4.461
U.S. Treasury Bonds 1,750 % fällig am 15.08.2041	$	5.400		3.808
Hungary Treasury Bills 0,000 % fällig am 20.04.2023	HUF	1.168.000		3.413
Hungary Treasury Bills 0,000 % fällig am 27.04.2023		1.172.000		3.379
Hungary Treasury Bills 0,000 % fällig am 13.04.2023		1.164.000		3.355
Malaysia Government International Bond 3,800 % fällig am 17.08.2023	MYR	14.600		3.131
Mexico Government International Bond 8,500 % fällig am 18.11.2038	MXN	46.000		2.545
South Africa Government International Bond 8,000 % fällig am 31.01.2030	ZAR	49.500		2.325
South Africa Government International Bond 6,500 % fällig am 28.02.2041		64.900		2.245
Bank Gospodarstwa Krajowego 5,375 % fällig am 22.05.2033	$	2.200		2.195
Ungarische Entwicklungsbank 6,500 % fällig am 29.06.2028		2.200		2.176
Philippines Government International Bond 5,000 % fällig am 17.07.2033		2.100		2.100

BESCHREIBUNG		AKTIEN		ERLÖSE (000S)
VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2023				
PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)		11.478.750	$	114.300
		PAR (000S)		
Mexico Government International Bond 5,000 % fällig am 06.03.2025	MXN	182.400		8.865
Saudi Arabia Government International Bond 4,875 % fällig am 18.07.2033	$	5.200		5.317
U.S. Treasury Bonds 3,375 % fällig am 15.08.2042		4.000		3.773
South Africa Government International Bond 8,000 % fällig am 31.01.2030	ZAR	75.100		3.715
U.S. Treasury Bonds 2,375 % fällig am 15.02.2042	$	4.300		3.458
Peru Government International Bond 8,200 % fällig am 12.08.2026	PEN	11.000		2.997
Petroleos Mexicanos 6,500 % fällig am 02.06.2041	$	4.000		2.466
U.S. Treasury Bonds 3,250 % fällig am 15.05.2042		2.500		2.315
Tierra Mojada Luxembourg SARL 5,750 % fällig am 01.12.2040		2.567		2.204
Philippines Government International Bond 5,000 % fällig am 17.07.2033		2.100		2.156
Mexico Government International Bond 6,350 % fällig am 09.02.2035		2.000		2.138
Mexico Government International Bond 5,400 % fällig am 09.02.2028		2.000		2.063
Airport Authority Hong Kong 4,875 % fällig am 12.01.2030		2.000		2.061
Morocco Government International Bond 6,500 % fällig am 08.09.2033		2.000		2.060
Colombian TES 3,750 % fällig am 25.02.2037	COP	11.447.877		2.047
Standard Chartered PLC 6,170 % fällig am 09.01.2027	$	2.000		2.025
Nykredit Realkredit A/S 1,000 % fällig am 01.10.2050	DKK	17.913		1.965
Corsair International Ltd. 7,772 % fällig am 28.01.2027	€	1.700		1.828
Khazanah Global Sukuk Bhd. 4,687 % fällig am 01.06.2028	$	1.600		1.590

(a) Der PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund legt in Anteile eines verbundenen Fonds an.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Fondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

BESCHREIBUNG		PAR (000S)		KOSTEN (000S)
KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2023				
Japan Treasury Bills 0,000 % fällig am 17.04.2023	¥	350.000	$	2.746
Malaysia Government International Bond 3,800 % fällig am 17.08.2023	MYR	5.400		1.158
Hungary Treasury Bills 0,000 % fällig am 27.04.2023	HUF	306.000		882
Hungary Treasury Bills 0,000 % fällig am 20.04.2023		164.000		479
Hungary Treasury Bills 0,000 % fällig am 13.04.2023		163.000		470
Peru Government International Bond 7,300 % fällig am 12.08.2033	PEN	1.300		353
Export-Import Bank of Korea 4,890 % fällig am 09.08.2023	INR	26.600		322
Mexico Government International Bond 7,000 % fällig am 03.09.2026	MXN	4.900		267
Bank Leumi Le-Israel B.M. 7,129 % fällig am 18.07.2033	$	200		200
Danske Bank A/S 6,466 % fällig am 09.01.2026		200		200
Standard Chartered PLC 6,170 % fällig am 09.01.2027		200		200
Gaci First Investment Co. 4,750 % fällig am 14.02.2030		200		198
Ungarische Entwicklungsbank 6,500 % fällig am 29.06.2028		200		198
Colombian TES 13,250 % fällig am 09.02.2033	COP	663.500		144
Dominican Republic Government International Bond 13,625 % fällig am 03.02.2033	DOP	8.000		141
South Africa Government International Bond 10,500 % fällig am 21.12.2026	ZAR	2.000		116
		AKTIEN		
PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)		10.112		101
		PAR (000S)		
Petroleos Mexicanos 10,000 % fällig am 07.02.2033	$	100		98
Malaysia Government Investment Issue 3,990 % fällig am 15.10.2025	MYR	400		92
Colombian TES 2,250 % fällig am 18.04.2029	COP	473.632		91

BESCHREIBUNG		PAR (000S)		ERLÖSE (000S)
VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2023				
Japan Treasury Bills 0,000 % fällig am 17.04.2023	¥	350.000	$	2.695
Israel Treasury Bills 0,000 % fällig am 03.05.2023	ILS	1.600		438
Export-Import Bank of Korea 4,890 % fällig am 09.08.2023	INR	26.600		322
Peru Government International Bond 7,300 % fällig am 12.08.2033	PEN	900		251
South Africa Government International Bond 10,500 % fällig am 21.12.2026	ZAR	3.600		229
Standard Chartered PLC 6,170 % fällig am 09.01.2027	$	200		204
Danske Bank A/S 6,466 % fällig am 09.01.2026		200		203
Colombian TES 9,250 % fällig am 28.05.2042	COP	1.167.800		203
Gaci First Investment Co. 4,750 % fällig am 14.02.2030	$	200		202
Lloyds Banking Group PLC 4,716 % fällig am 11.08.2026		200		196
Greenko Solar Mauritius Ltd. 5,950 % fällig am 29.07.2026		200		185
Colombian TES 13,250 % fällig am 09.02.2033	COP	663.500		168
Nykredit Realkredit A/S 1,500 % fällig am 01.10.2053	DKK	1.467		166
		AKTIEN		
PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)		10.041		100
PIMCO ETFs plc - PIMCO US Dollar Short Maturity UCITS ETF (a)		1.000		99
		PAR (000S)		
Leviathan Bond Ltd. 6,125 % fällig am 30.06.2025	$	100		99
Colombian TES 2,250 % fällig am 18.04.2029	COP	479.715		99
Nakilat, Inc. 6,067 % fällig am 31.12.2033	$	89		95
Empresas Publicas de Medellin ESP 8,375 % fällig am 08.11.2027	COP	489.000		90
Nykredit Realkredit A/S 1,000 % fällig am 01.10.2050	DKK	589		64

(a) Der Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund legt in Anteile eines verbundenen Fonds an.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Fondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

BESCHREIBUNG		PAR (000S)		KOSTEN (000S)
KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2023				
Uniform Mortgage-Backed Security 5,500 % fällig am 01.06.2053	$	21.763	$	21.847
EMF-UK PLC 5,970 % fällig am 13.03.2046	£	3.566		4.219
TDC Net A/S 5,618 % fällig am 06.02.2030	€	2.700		2.944
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,250 % fällig am 15.01.2025 (a)	$	2.547		2.455
Great Hall Mortgages PLC 5,282 % fällig am 18.06.2038	£	2.040		2.387
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.10.2024 (a)	$	1.842		1.780
JPMorgan Mortgage Acquisition Trust 4,459 % fällig am 25.01.2037		3.177		1.752
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.07.2024 (a)		1.702		1.654
Towd Point Mortgage Funding PLC 5,161 % fällig am 20.10.2051	£	1.300		1.540
Philippines Government International Bond 5,500 % fällig am 17.01.2048	$	1.500		1.500
Verizon Communications, Inc. 5,050 % fällig am 09.05.2033		1.500		1.498
Pacific Gas & Electric Co. 6,700 % fällig am 01.04.2053		1.300		1.295
KBC Group NV 5,796 % fällig am 19.01.2029		1.250		1.250
Bridgegate Funding PLC 8,466 % fällig am 16.10.2062	£	950		1.091
245 Park Avenue Trust 3,779 % fällig am 05.06.2037	$	1.250		1.089
Bridgegate Funding PLC 9,466 % fällig am 16.10.2062	£	950		1.087
Uniform Mortgage-Backed Security 4,500 % fällig am 01.12.2052	$	1.099		1.065
Societe Generale S.A. 6,691 % fällig am 10.01.2034		1.000		1.004
Amgen, Inc. 5,600 % fällig am 02.03.2043		900		895
Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc. 5,475 % fällig am 22.02.2031		800		800
CenterPoint Energy Houston Electric LLC 5,300 % fällig am 01.04.2053		800		799
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,625 % fällig am 15.01.2024 (a)		817		799
Intesa Sanpaolo SpA 6,625 % fällig am 31.05.2033	£	600		735

BESCHREIBUNG		PAR (000S)		ERLÖSE (000S)
VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2023				
Philippines Government International Bond 5,500 % fällig am 17.01.2048	$	1.500	$	1.560
Viridis European Loan Conduit 5,724 % fällig am 22.07.2029	£	900		1.095
Indian Railway Finance Corp. Ltd. 3,570 % fällig am 21.01.2032	$	950		841
Starwood Property Trust, Inc. 3,625 % fällig am 15.07.2026		680		585
Hong Kong Government International Bond 5,250 % fällig am 11.01.2053		500		546
Clearway Energy Operating LLC 3,750 % fällig am 15.02.2031		630		538
Verallia S.A. 1,625 % fällig am 14.05.2028	€	500		487
Natura Cosmeticos S.A. 4,125 % fällig am 03.05.2028	$	600		482
Prosus NV 3,061 % fällig am 13.07.2031		600		469
Leeward Renewable Energy Operations LLC 4,250 % fällig am 01.07.2029		500		448
Verallia S.A. 1,875 % fällig am 10.11.2031	€	500		447
Transalta Corp. 7,750 % fällig am 15.11.2029	$	400		421
Nokia Oyj 3,125 % fällig am 15.05.2028	€	400		419
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A. 5,875 % fällig am 24.09.2023		400		414
Radian Group, Inc. 6,625 % fällig am 15.03.2025	$	400		399
Banco do Brasil S.A. 4,875 % fällig am 11.01.2029		400		377
DaVita, Inc. 3,750 % fällig am 15.02.2031		400		323
Coty, Inc. 3,875 % fällig am 15.04.2026	€	300		317
Rexel S.A. 2,125 % fällig am 15.12.2028		300		287
Owens Corning 3,950 % fällig am 15.08.2029	$	300		286
Prosus NV 3,257 % fällig am 19.01.2027		300		274
Starwood Property Trust, Inc. 4,375 % fällig am 15.01.2027		310		266
Intesa Sanpaolo SpA 6,250 % fällig am 16.05.2024	€	200		214
Sixt SE 1,750 % fällig am 09.12.2024		200		211
Allegion U.S. Holding Co., Inc. 3,550 % fällig am 01.10.2027	$	200		190
Atlantica Sustainable Infrastructure PLC 4,125 % fällig am 15.06.2028		200		183
NextEra Energy Operating Partners LP 3,875 % fällig am 15.10.2026		180		169
Greenko Dutch BV 3,850 % fällig am 29.03.2026		188		169
Greenko Power Ltd. 4,300 % fällig am 13.12.2028		191		165
BNP Paribas S.A. 2,871 % fällig am 19.04.2032		200		164
Owl Rock Capital Corp. 2,875 % fällig am 11.06.2028		200		164
MPT Operating Partnership LP 3,375 % fällig am 24.04.2030	£	200		150
Fortune Brands Home & Security, Inc. 3,250 % fällig am 15.09.2029	$	150		133

(a) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Fondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des Euro Bond Fund

BESCHREIBUNG		AKTIEN	KOSTEN (000S)
KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2023			
PIMCO ETFs plc - PIMCO Euro Short Maturity UCITS ETF (a)		283.500	€ 27.505
		PAR (000S)	
Europäische Union 2,750 % fällig am 04.12.2037	€	17.900	17.327
Europäische Union 3,375 % fällig am 04.10.2038		14.820	14.748
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 4,500 % fällig am 01.10.2053		14.300	14.237
		AKTIEN	
PIMCO ETFs plc - PIMCO Euro Short Maturity UCITS ETF (a)		146.000	13.994
		PAR (000S)	
BMW Finance NV 3,609 % fällig am 09.12.2024	€	10.400	10.400
Credit Mutuel Home Loan SFH S.A. 3,250 % fällig am 20.04.2029		9.700	9.669
France Government International Bond 0,550 % fällig am 01.03.2039		8.710	8.585
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.07.2024 (b)	$	7.361	6.606
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,500 % fällig am 15.04.2024 (b)		7.289	6.561
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,625 % fällig am 15.01.2024 (b)		7.233	6.555
Spain Government International Bond 0,000 % fällig am 31.01.2028	€	7.100	6.240
UniCredit SpA 3,375 % fällig am 31.01.2027		6.000	5.983
Europäische Union 2,750 % fällig am 05.10.2026		6.000	5.983
Hops Hill PLC 0,000 % fällig am 21.12.2055	£	5.200	5.940
Toronto-Dominion Bank 3,879 % fällig am 13.03.2026	€	5.700	5.700
Banco BPM SpA 3,750 % fällig am 27.06.2028		5.700	5.693
Harvest CLO DAC 3,907 % fällig am 15.10.2030		5.676	5.578
Pierpont BTL PLC 0,000 % fällig am 21.09.2054	£	4.800	5.502
Cassa Depositi e Prestiti SpA 5,750 % fällig am 05.05.2026	$	6.000	5.439
Red & Black Auto Lease France 4,093 % fällig am 27.06.2035	€	5.400	5.400
Canada Square Funding PLC 5,316 % fällig am 17.01.2059	£	4.582	5.313
SCF Rahoituspalvelut DAC 4,020 % fällig am 25.06.2033	€	5.300	5.300
Svensk Exportkredit AB 3,250 % fällig am 13.04.2026		5.300	5.299
Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 2,875 % fällig am 29.05.2026		5.200	5.182
Ginkgo Sales Finance 4,113 % fällig am 25.11.2049		5.150	5.149
Royal Bank of Canada 3,607 % fällig am 17.01.2025		5.000	5.000
Credit Mutuel Home Loan SFH S.A. 3,125 % fällig am 22.06.2027		4.900	4.888
Federation des Caisses Desjardins du Quebec 3,250 % fällig am 18.04.2028		4.700	4.680
Twin Bridges PLC 5,715 % fällig am 12.03.2055	£	4.031	4.662
Spain Government International Bond 2,800 % fällig am 31.05.2026	€	4.500	4.490
Oak No. 4 PLC 0,000 % fällig am 26.02.2065	£	3.850	4.436
Europäische Union 2,625 % fällig am 04.02.2048	€	4.700	4.133
Revocar UG 4,032 % fällig am 21.04.2036		4.100	4.100
Twin Bridges PLC 5,525 % fällig am 12.09.2055	£	3.443	3.972
Towd Point Mortgage Funding PLC 5,841 % fällig am 20.07.2045		2.821	3.289
Autonoria FCT 3,883 % fällig am 26.01.2043	€	3.200	3.200

BESCHREIBUNG		AKTIEN	ERLÖSE (000S)
VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2023			
PIMCO ETFs plc - PIMCO Euro Short Maturity UCITS ETF (a)		833.400	€ 80.366
		PAR (000S)	
Nykredit Realkredit A/S 1,000 % fällig am 01.10.2050	DKK	392.712	37.100
Europäische Union 2,750 % fällig am 04.12.2037	€	17.900	16.736
Europäische Union 0,250 % fällig am 22.04.2036		23.000	16.386
		AKTIEN	
PIMCO ETFs plc - PIMCO Euro Short Maturity UCITS ETF (a)		132.500	12.844
		PAR (000S)	
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2,150 % fällig am 01.09.2052	€	19.000	12.014
Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 0,000 % fällig am 15.06.2029		11.100	9.311
France Government International Bond 0,100 % fällig am 25.07.2038		9.260	8.470
Citigroup, Inc. 4,412 % fällig am 31.03.2031	$	8.100	7.254
Spain Government International Bond 2,550 % fällig am 31.10.2032	€	7.400	7.162
Credit Mutuel Home Loan SFH S.A. 3,250 % fällig am 20.04.2029		5.900	5.851
Spain Government International Bond 1,400 % fällig am 30.07.2028		6.000	5.517
Spain Government International Bond 0,000 % fällig am 31.01.2026		6.000	5.515
Electricite de France S.A. 2,625 % fällig am 01.12.2027		6.600	5.429
JAB Holdings BV 2,000 % fällig am 18.05.2028		5.100	4.667
Nordea Kredit Realkreditaktieselskab 1,000 % fällig am 01.10.2050	DKK	47.800	4.595
Spain Government International Bond 1,950 % fällig am 30.04.2026	€	4.600	4.487
Nykredit Realkredit A/S 1,500 % fällig am 01.10.2053	DKK	42.300	4.191
Holding d'Infrastructures de Transport SASU 1,475 % fällig am 18.01.2031	€	4.900	4.030
Barclays PLC 2,885 % fällig am 31.01.2027		4.000	3.866
Europäische Union 0,750 % fällig am 04.01.2047		6.100	3.628
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2,800 % fällig am 01.03.2067		5.000	3.606
Nexi SpA 1,625 % fällig am 30.04.2026		3.797	3.484
Europäische Investitionsbank 0,250 % fällig am 20.01.2032		4.200	3.341
Dexia Credit Local S.A. 0,500 % fällig am 17.01.2025		3.500	3.327
Europäische Union 0,000 % fällig am 04.07.2031		4.200	3.321

(a) Der Euro Bond Fund legt in Anteile eines verbundenen Fonds an.

(b) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Fondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

BESCHREIBUNG		PAR (000S)		KOSTEN (000S)
KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2023				
Europäische Union 0,000 % fällig am 04.10.2030	€	15.400	€	12.406
Europäische Investitionsbank 2,250 % fällig am 15.03.2030		12.800		12.294
Europäische Finanzstabilisierungsfazilität 3,000 % fällig am 15.12.2028		11.000		10.940
Europäische Investitionsbank 0,050 % fällig am 13.10.2034		12.700		9.141
Europäische Union 2,750 % fällig am 04.02.2033		7.600		7.529
Region of Ile de France 3,050 % fällig am 03.02.2033		7.200		7.183
Romania Government International Bond 6,625 % fällig am 27.09.2029		6.400		6.606
Europäische Union 0,000 % fällig am 04.11.2025		6.700		6.204
Europäische Union 1,500 % fällig am 04.10.2035		7.400		6.189
Europäische Union 0,400 % fällig am 04.02.2037		8.900		6.130
Europäischer Stabilitätsmechanismus 0,750 % fällig am 15.03.2027		6.700		6.118
Europäische Finanzstabilisierungsfazilität 1,250 % fällig am 24.05.2033		7.000		6.103
Europäische Union 0,450 % fällig am 04.07.2041		9.700		6.092
Europäische Finanzstabilisierungsfazilität 2,375 % fällig am 11.04.2028		6.300		6.091
Europäische Investitionsbank 0,250 % fällig am 20.01.2032		7.500		6.088
BNG Bank NV 3,000 % fällig am 11.01.2033		6.000		5.997
Europäische Union 2,750 % fällig am 04.12.2037		6.200		5.964
France Government International Bond 1,750 % fällig am 25.05.2023		5.600		5.588
Hamburg Commercial Bank AG 6,250 % fällig am 18.11.2024		5.300		5.486
Cooperatieve Rabobank UA 4,000 % fällig am 10.01.2030		5.100		5.078
Cooperatieve Rabobank UA 4,655 % fällig am 22.08.2028	$	5.200		4.636
Werfen S.A. 4,625 % fällig am 06.06.2028	€	4.600		4.560
Province of Quebec 3,000 % fällig am 24.01.2033		4.200		4.161
Verizon Communications, Inc. 4,750 % fällig am 31.10.2034		3.600		3.752
American Tower Corp. 4,625 % fällig am 16.05.2031		3.500		3.478
Morgan Stanley 5,123 % fällig am 01.02.2029	$	3.600		3.333
ORIX Corp. 4,477 % fällig am 01.06.2028	€	3.300		3.300

BESCHREIBUNG		PAR (000S)		ERLÖSE (000S)
VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2023				
UBS Group AG 1,250 % fällig am 17.04.2025	€	8.400	€	8.126
Nordea Kredit Realkreditaktieselskab 1,000 % fällig am 01.10.2050	DKK	78.904		7.577
Nykredit Realkredit A/S 1,000 % fällig am 01.10.2050		74.128		7.479
Wells Fargo & Co. 1,000 % fällig am 02.02.2027	€	7.600		6.804
Nationwide Building Society 4,363 % fällig am 01.08.2024	$	6.800		6.300
UBS Group AG 1,250 % fällig am 17.07.2025	€	6.900		6.238
Mizuho Financial Group, Inc. 3,490 % fällig am 05.09.2027		5.300		5.178
Cooperatieve Rabobank UA 4,000 % fällig am 10.01.2030		5.100		5.141
Barclays PLC 0,577 % fällig am 09.08.2029		6.400		5.126
Logicor Financing SARL 2,250 % fällig am 13.05.2025		5.500		5.039
BNP Paribas S.A. 0,500 % fällig am 04.06.2026		5.400		5.021
Carlyle Global Market Strategies Euro CLO DAC 3,927 % fällig am 15.07.2030		4.887		4.810
NatWest Group PLC 2,000 % fällig am 04.03.2025		4.900		4.798
Worldline S.A. 1,625 % fällig am 13.09.2024		4.800		4.645
CaixaBank S.A. 3,750 % fällig am 07.09.2029		4.500		4.509
Global Switch Holdings Ltd. 1,500 % fällig am 31.01.2024		4.600		4.507
InterContinental Hotels Group PLC 2,125 % fällig am 15.05.2027		4.600		4.287
Stratton Mortgage Funding PLC 5,391 % fällig am 20.07.2060	£	3.724		4.236
Fraport AG Frankfurt Airport Services Worldwide 2,125 % fällig am 09.07.2027	€	4.300		4.016
ING Groep NV 3,000 % fällig am 18.02.2026	£	3.600		3.847
Standard Chartered PLC 1,214 % fällig am 23.03.2025	$	3.800		3.377
Santander UK Group Holdings PLC 0,603 % fällig am 13.09.2029	€	4.200		3.375
Goldman Sachs Group, Inc. 0,875 % fällig am 09.05.2029		4.100		3.349
ORIX Corp. 4,477 % fällig am 01.06.2028		3.300		3.322
Jyske Realkredit A/S 1,000 % fällig am 01.10.2050	DKK	31.738		3.227
Teva Pharmaceutical Finance Netherlands BV 7,375 % fällig am 15.09.2029	€	3.100		3.115
AMCO - Asset Management Co. SpA 4,625 % fällig am 06.02.2027		3.100		3.091
Romania Government International Bond 6,625 % fällig am 27.09.2029		3.000		3.077
Charter Communications Operating LLC 6,795 % fällig am 01.02.2027	$	3.300		3.056
Fairfax Financial Holdings Ltd. 2,750 % fällig am 29.03.2028	€	3.400		3.056
UBS Group AG 4,282 % fällig am 09.01.2028	$	3.600		3.053
Hilton Domestic Operating Co., Inc. 6,939 % fällig am 22.06.2026		3.240		3.021
Syngenta Finance NV 3,375 % fällig am 16.04.2026	€	3.100		2.988
Cie Plastic Omnium S.A. 1,250 % fällig am 26.06.2024		3.000		2.892
DAE Funding LLC 1,625 % fällig am 15.02.2024	$	3.200		2.883
Deutsche Bank AG 0,750 % fällig am 17.02.2027	€	3.200		2.835
Nissan Motor Co. Ltd. 2,652 % fällig am 17.03.2026		3.000		2.791

BESCHREIBUNG		PAR (000S)		ERLÖSE (000S)
VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2023 (Forts.)				
QNB Finance Ltd.				
1,375 % fällig am 26.01.2026	$	3.300	€	2.750
Nordea Kredit Realkreditaktieselskab				
1,000 % fällig am 01.10.2050	DKK	26.040		2.647
TDF Infrastructure SASU				
1,750 % fällig am 01.12.2029	€	3.200		2.594

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Fondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

BESCHREIBUNG		PAR (000S)		KOSTEN (000S)
KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2023				
Jupiter Mortgage PLC 5,891 % fällig am 20.07.2060	£	24.700	€	27.420
Bridgegate Funding PLC 6,716 % fällig am 16.10.2062		24.122		26.663
Dutch Property Finance BV 4,168 % fällig am 28.04.2064	€	16.200		15.995
Shamrock Residential DAC 4,439 % fällig am 24.06.2071		15.000		14.787
Glenbeigh Issuer DAC 4,350 % fällig am 24.06.2050		14.848		14.629
France Government International Bond 0,000 % fällig am 25.03.2023		14.600		14.550
Barclays PLC 7,437 % fällig am 02.11.2033	$	12.226		12.596
Tower Bridge Funding PLC 5,991 % fällig am 20.10.2064	£	10.400		11.876
NatWest Group PLC 6,016 % fällig am 02.03.2034	$	11.900		11.225
BPCE S.A. 5,748 % fällig am 19.07.2033		12.100		11.072
Pacific Gas & Electric Co. 6,150 % fällig am 15.01.2033		11.700		11.005
HSBC Holdings PLC 5,402 % fällig am 11.08.2033		12.000		10.902
Atrium Hotel Portfolio Trust 7,093 % fällig am 15.06.2035		9.700		8.681
Option One Mortgage Loan Trust 5,330 % fällig am 25.04.2037		13.654		7.290
Societe Generale S.A. 6,446 % fällig am 10.01.2029		7.200		6.821
UBS Commercial Mortgage Trust 6,693 % fällig am 15.02.2032		7.520		6.700
KBC Group NV 5,796 % fällig am 19.01.2029		7.200		6.695
UBS Group AG 7,750 % fällig am 01.03.2029	€	6.400		6.664
Harbour Energy PLC 5,457 % fällig am 28.01.2054	£	5.700		6.300
Stratton Mortgage Funding PLC 6,991 % fällig am 20.07.2060		5.594		6.204
France Government International Bond 1,750 % fällig am 25.05.2023	€	5.380		5.368
Soundview Home Loan Trust 6,150 % fällig am 25.09.2037	$	7.944		5.244
Intesa Sanpaolo SpA 8,248 % fällig am 21.11.2033		4.950		4.927
Ludgate Funding PLC 3,212 % fällig am 01.01.2061	€	5.062		4.807
IndyMac Mortgage Loan Trust 5,770 % fällig am 25.10.2036	$	9.569		4.740
Pacific Gas & Electric Co. 6,100 % fällig am 15.01.2029		5.000		4.657
Pacific Gas & Electric Co. 6,400 % fällig am 15.06.2033		5.000		4.655
Countrywide Alternative Loan Trust 5,500 % fällig am 25.03.2035		5.570		4.583
RMAC Securities PLC 5,254 % fällig am 12.06.2044	£	4.276		4.517
Fremont Home Loan Trust 5,270 % fällig am 25.01.2037	$	10.545		4.497
Option One Mortgage Loan Trust 5,250 % fällig am 25.07.2036		10.720		4.451
HSI Asset Securitization Corp. Trust 5,525 % fällig am 25.05.2037		4.600		4.109

BESCHREIBUNG		PAR (000S)		ERLÖSE (000S)
VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2023				
France Government International Bond 0,000 % fällig am 25.03.2023	€	21.750	€	21.715
Fairfax Financial Holdings Ltd. 2,750 % fällig am 29.03.2028		21.600		19.218
Nykredit Realkredit A/S 1,000 % fällig am 01.10.2053	DKK	168.664		16.983
HSBC Holdings PLC 1,589 % fällig am 24.05.2027	$	17.500		14.307
Loxam S.A.S. 3,250 % fällig am 14.01.2025	€	14.600		13.966
		AKTIEN		
PIMCO ETFs plc - PIMCO Euro Short Maturity UCITS ETF (a)		137.900		13.231
		PAR (000S)		
Syngenta Finance NV 3,375 % fällig am 16.04.2026	€	13.600		13.148
Societa per Azioni Esercizi Aeroportuali SEA SpA 3,500 % fällig am 09.10.2025		14.000		13.108
Banco de Sabadell S.A. 1,125 % fällig am 27.03.2025		14.000		12.872
Deutsche Bank AG 1,625 % fällig am 20.01.2027		14.200		12.616
Nykredit Realkredit A/S 1,000 % fällig am 01.10.2050	DKK	112.167		11.274
Pacific Gas & Electric Co. 6,150 % fällig am 15.01.2033	$	11.700		10.992
Nissan Motor Co. Ltd. 2,652 % fällig am 17.03.2026	€	11.400		10.717
Mundys SpA 1,875 % fällig am 12.02.2028		11.500		9.831
Societe Generale S.A. 2,226 % fällig am 21.01.2026	$	11.000		9.624
IHO Verwaltungs GmbH 3,625 % fällig am 15.05.2025	€	10.200		9.614
Fraport AG Frankfurt Airport Services Worldwide 2,125 % fällig am 09.07.2027		10.500		9.562
Accor S.A. 2,375 % fällig am 29.11.2028		9.600		8.237
TP ICAP Finance PLC 2,625 % fällig am 18.11.2028	£	8.600		7.779
Nordea Kredit Realkreditaktieselskab 1,000 % fällig am 01.10.2050	DKK	75.223		7.222
Avolon Holdings Funding Ltd. 2,875 % fällig am 15.02.2025	$	7.700		6.689
UBS Group AG 1,250 % fällig am 17.07.2025	€	7.000		6.682
WPC Eurobond BV 1,350 % fällig am 15.04.2028		7.000		5.922
Santander UK Group Holdings PLC 0,603 % fällig am 13.09.2029		7.500		5.899
Sofina S.A. 1,000 % fällig am 23.09.2028		7.400		5.819
Grifols S.A. 5,633 % fällig am 15.11.2027		6.000		5.705
Avolon TLB Borrower (U.S.) LLC 7,396 % fällig am 01.12.2027	$	5.670		5.170
Ivory Coast Government International Bond 5,250 % fällig am 22.03.2030	€	6.000		5.141
KBC Group NV 5,796 % fällig am 19.01.2029	$	5.200		4.878
INEOS Finance PLC 6,168 % fällig am 08.11.2028	€	5.000		4.761
AA Bond Co. Ltd. 5,500 % fällig am 31.07.2050	£	4.510		4.650

(a) Der Euro Income Bond Fund legt in Anteile eines verbundenen Fonds an.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Fondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

BESCHREIBUNG		PAR (000S)		KOSTEN (000S)
KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2023				
France Government International Bond 4,500 % fällig am 25.04.2041	€	47.000	€	55.092
France Government International Bond 4,000 % fällig am 25.10.2038		34.500		37.869
France Government International Bond 2,500 % fällig am 25.05.2043		27.700		24.485
France Government International Bond 4,000 % fällig am 25.04.2060		17.900		20.809
France Government International Bond 3,250 % fällig am 25.05.2045		20.400		20.520
France Government International Bond 3,000 % fällig am 25.05.2054		18.900		17.701
		AKTIEN		
PIMCO ETFs plc - PIMCO Euro Short Maturity UCITS ETF (a)		179.500		17.243
		PAR (000S)		
Netherlands Government International Bond 2,750 % fällig am 15.01.2047	€	13.700		13.989
France Government International Bond 0,750 % fällig am 25.05.2052		23.200		12.774
Bundesrepublik Deutschland 4,750 % fällig am 04.07.2040		9.300		12.149
France Government International Bond 4,000 % fällig am 25.04.2055		10.200		11.639
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 1,625 % fällig am 15.10.2027 (b)	$	10.338		9.366
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,625 % fällig am 15.01.2024 (b)		8.703		7.846
Netherlands Government International Bond 0,000 % fällig am 15.01.2052	€	16.000		7.816
France Government International Bond 1,500 % fällig am 25.05.2050		11.300		7.724
Netherlands Government International Bond 0,000 % fällig am 15.01.2038		11.300		7.608
Bundesrepublik Deutschland 2,500 % fällig am 15.08.2046		7.300		7.477
France Government International Bond 2,000 % fällig am 25.05.2048		8.200		6.391
France Government International Bond 0,750 % fällig am 25.05.2053		12.100		6.297
Slovenia Government International Bond 1,500 % fällig am 25.03.2035		7.600		6.135
France Government International Bond 1,250 % fällig am 25.05.2038		7.700		6.004
France Government International Bond 1,750 % fällig am 25.05.2066		7.000		4.742
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.07.2024 (b)	$	5.103		4.549

BESCHREIBUNG		AKTIEN		ERLÖSE (000S)
VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2023				
PIMCO ETFs plc - PIMCO Euro Short Maturity UCITS ETF (a)		116.900	€	11.213
		PAR (000S)		
France Government International Bond 0,750 % fällig am 25.05.2052	€	19.500		10.161
France Government International Bond 2,500 % fällig am 25.05.2043		7.600		6.516
France Government International Bond 2,000 % fällig am 25.05.2048		6.450		4.951
France Government International Bond 4,000 % fällig am 25.04.2055		2.800		3.104
France Government International Bond 3,250 % fällig am 25.05.2045		3.100		3.063
Bundesrepublik Deutschland 2,500 % fällig am 15.08.2046		2.900		2.874
Nykredit Realkredit A/S 1,000 % fällig am 01.10.2050	DKK	26.741		2.518
France Government International Bond 1,750 % fällig am 25.06.2039	€	2.850		2.405
United Kingdom Gilt 0,125 % fällig am 30.01.2026	£	1.900		1.954
France Government International Bond 4,000 % fällig am 25.04.2060	€	1.650		1.855
Ministeries van de Vlaamse Gemeenschap 3,250 % fällig am 12.01.2043		1.500		1.405
France Government International Bond 0,500 % fällig am 25.06.2044		2.000		1.235
France Government International Bond 0,500 % fällig am 25.05.2072		2.600		1.005
Europäische Union 0,300 % fällig am 04.11.2050		1.800		853
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.01.2032 (b)	$	964		808
France Government International Bond 1,500 % fällig am 25.05.2050	€	1.100		780
Nykredit Realkredit A/S 3,500 % fällig am 01.10.2053	DKK	6.011		741
Landmark Mortgage Securities PLC 4,865 % fällig am 17.04.2044	£	681		720
Banco Santander S.A. 2,375 % fällig am 08.09.2027	€	700		675

(a) Der Euro Long Average Duration Fund legt in Anteile eines verbundenen Fonds an.

(b) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Fondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des Euro Short-Term Fund

30. Juni 2023

BESCHREIBUNG		PAR (000S)		KOSTEN (000S)
KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2023				
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,375 % fällig am 15.07.2025 (a)	$	14.211	€	12.578
Towd Point Mortgage Funding PLC 6,216 % fällig am 20.02.2045	£	2.997		3.513
Westpac Banking Corp. 3,457 % fällig am 04.04.2025	€	1.500		1.500
ING Bank NV 3,000 % fällig am 15.02.2026		1.500		1.495
Hana Bank 3,750 % fällig am 04.05.2026		1.400		1.399
Burberry Group PLC 1,125 % fällig am 21.09.2025	£	1.100		1.150
Heathrow Funding Ltd. 1,500 % fällig am 12.10.2027	€	1.200		1.143
Fortum Oyj 1,625 % fällig am 27.02.2026		1.200		1.138
JAB Holdings BV 1,750 % fällig am 25.06.2026		1.200		1.135
Thames Water Utilities Finance PLC 4,000 % fällig am 19.06.2025	£	1.000		1.120
Tesco Corporate Treasury Services PLC 0,875 % fällig am 29.05.2026	€	1.200		1.109
Australia & New Zealand Banking Group Ltd. 3,437 % fällig am 04.04.2025		1.100		1.100
Nationale-Nederlanden Bank NV 0,500 % fällig am 10.10.2056		1.100		1.051
ING Groep NV 0,125 % fällig am 29.11.2025		1.100		1.025
Royal Bank of Canada 3,607 % fällig am 17.01.2025		1.000		1.000
Toronto-Dominion Bank 3,650 % fällig am 20.01.2025		1.000		1.000
Banco Santander S.A. 3,375 % fällig am 11.01.2026		1.000		999
BNG Bank NV 0,050 % fällig am 11.07.2023		1.000		999
Cairn CLO DAC 3,842 % fällig am 30.04.2031		986		965
Stanlington PLC 5,815 % fällig am 12.06.2045	£	816		920
Harvest CLO DAC 3,907 % fällig am 15.01.2031	€	931		914
Cars Alliance Auto Loans Germany 3,860 % fällig am 18.03.2035		900		900
Bank of Nova Scotia 3,704 % fällig am 02.05.2025		900		900
Lloyds Bank PLC 3,250 % fällig am 02.02.2026		900		900
Bank of Ireland Group PLC 0,750 % fällig am 08.07.2024		900		899
South Korea Government International Bond 2,125 % fällig am 10.06.2024		900		886
Rochester Financing PLC 5,602 % fällig am 18.12.2044	£	790		883
Stratton BTL Mortgage Funding PLC 5,221 % fällig am 20.01.2054		779		868
Bavarian Sky S.A. 3,765 % fällig am 20.03.2030	€	800		800
Autonoria FCT 3,883 % fällig am 26.01.2043		800		800
Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd. 3,629 % fällig am 06.04.2026		800		800
Dilosk RMBS DAC 4,070 % fällig am 20.07.2061		800		800
Revocar UG 4,032 % fällig am 21.04.2036		800		800
Bavarian Sky UK PLC 5,407 % fällig am 20.04.2031	£	700		794
Ginkgo Sales Finance 4,113 % fällig am 25.11.2049	€	749		749
Cassa Depositi e Prestiti SpA 5,750 % fällig am 05.05.2026	$	800		725
BMW Finance NV 3,609 % fällig am 09.12.2024	€	700		700

BESCHREIBUNG		PAR (000S)		KOSTEN (000S)
KÄUFE BIS 30. JUNI 2023 (Forts.)				
Silver Arrow S.A. 3,768 % fällig am 15.02.2030	€	700	€	700
Commerzbank AG 3,375 % fällig am 12.12.2025		700		699
CaixaBank S.A. 4,625 % fällig am 16.05.2027		700		699
Realkredit Danmark A/S 2,860 % fällig am 01.07.2023	DKK	5.200		698
National Australia Bank Ltd. 5,507 % fällig am 17.06.2026	£	600		691
Sumitomo Mitsui Banking Corp. 3,602 % fällig am 16.02.2026	€	690		690
Credit Suisse Schweiz AG 3,390 % fällig am 05.12.2025		700		680
Harbour Energy PLC 5,358 % fällig am 28.01.2054	£	591		669
Svensk Exportkredit AB 3,250 % fällig am 13.04.2026	€	650		650
Koninklijke Philips NV 0,500 % fällig am 22.05.2026		700		641
Chanel Ceres PLC 0,500 % fällig am 31.07.2026		700		636

BESCHREIBUNG		PAR (000S)		ERLÖSE (000S)
VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2023				
Sumitomo Mitsui Banking Corp. 0,550 % fällig am 06.11.2023	€	7.300	€	7.183
Bank of China Ltd. 5,216 % fällig am 10.08.2023	£	5.000		5.616
Trinity Square PLC 5,316 % fällig am 15.07.2059		4.441		5.003
Towd Point Mortgage Funding PLC 5,635 % fällig am 20.10.2051		3.629		4.256
Bain Capital Euro CLO DAC 3,940 % fällig am 20.01.2032	€	3.800		3.717
Korea Housing Finance Corp. 0,723 % fällig am 22.03.2025		3.700		3.495
Precise Mortgage Funding PLC 6,065 % fällig am 12.12.2055	£	2.804		3.243
Fraport AG Frankfurt Airport Services Worldwide 1,625 % fällig am 09.07.2024	€	3.200		3.113
Becton Dickinson & Co. 0,000 % fällig am 13.08.2023		3.000		2.970
Caja Rural de Navarra SCC 0,625 % fällig am 01.12.2023		3.000		2.952
Schaeffler AG 1,875 % fällig am 26.03.2024		3.000		2.934
Jubilee Place BV 4,027 % fällig am 17.01.2059		2.899		2.884
Canada Square Funding PLC 5,852 % fällig am 17.06.2058	£	2.535		2.814
Lanebrook Mortgage Transaction PLC 5,141 % fällig am 20.07.2058		2.512		2.802
BNZ International Funding Ltd. 0,625 % fällig am 03.07.2025	€	2.900		2.719
Dexia Credit Local S.A. 0,250 % fällig am 01.06.2023		2.600		2.593
Morgan Stanley 0,637 % fällig am 26.07.2024		2.600		2.587
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,375 % fällig am 15.07.2025 (a)	$	2.669		2.384
Hops Hill PLC 6,204 % fällig am 27.11.2054	£	1.959		2.230
Clydesdale Bank PLC 5,540 % fällig am 22.03.2026		1.900		2.178
Toronto-Dominion Bank 4,954 % fällig am 22.04.2025		1.900		2.150
Freddie Mac 0,800 % fällig am 28.10.2026	$	2.600		2.137
Societe Generale S.A. 1,250 % fällig am 15.02.2024	€	2.100		2.059
Freddie Mac 0,650 % fällig am 27.10.2025	$	2.400		2.018
Yorkshire Building Society 0,375 % fällig am 11.04.2023	€	2.000		1.993
Nissan Motor Co. Ltd. 1,940 % fällig am 15.09.2023		2.000		1.975
Ripon Mortgages PLC 5,491 % fällig am 28.08.2056	£	1.636		1.876
Teollisuuden Voima Oyj 2,125 % fällig am 04.02.2025	€	1.900		1.812
Australia & New Zealand Banking Group Ltd. 0,250 % fällig am 17.03.2025		1.900		1.792
Bank of Nova Scotia 3,050 % fällig am 31.10.2024		1.800		1.790
Poland Government International Bond 0,000 % fällig am 07.07.2023		1.800		1.786
Cairn CLO DAC 3,912 % fällig am 31.01.2030		1.790		1.759
Land Securities Capital Markets PLC 1,974 % fällig am 08.02.2024	£	1.500		1.698
Nationwide Building Society 0,250 % fällig am 22.07.2025	€	1.800		1.664
LeasePlan Corp. NV 0,125 % fällig am 13.09.2023		1.600		1.568
Korea Housing Finance Corp. 0,010 % fällig am 05.02.2025		1.600		1.499
Logicor Financing SARL 0,750 % fällig am 15.07.2024		1.600		1.494

BESCHREIBUNG		PAR (000S)		ERLÖSE (000S)
VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2023 (Forts.)				
ING Bank NV 3,000 % fällig am 15.02.2026	€	1.500	€	1.491
Goldman Sachs Group, Inc. 3,750 % fällig am 30.04.2024		1.500		1.490
Bank of Ireland Group PLC 1,375 % fällig am 29.08.2023		1.500		1.489

(a) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Fondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

BESCHREIBUNG		PAR (000S)	KOSTEN (000S)
KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2023			
Ford Motor Credit Co. LLC 4,867 % fällig am 03.08.2027	€	4.150	€ 4.150
Ford Motor Credit Co. LLC 3,625 % fällig am 17.06.2031	$	5.100	3.771
France Government International Bond 0,000 % fällig am 25.03.2023	€	3.090	3.078
Pinnacle Bidco PLC 6,375 % fällig am 15.02.2025	£	2.800	2.991
Spectrum Brands, Inc. 4,000 % fällig am 01.10.2026	€	3.000	2.874
		AKTIEN	
PIMCO ETFs plc - PIMCO Euro Short Maturity UCITS ETF (a)		29.500	2.826
		PAR (000S)	
Rolls-Royce PLC 4,625 % fällig am 16.02.2026	€	2.600	2.559
Electricite de France S.A. 6,000 % fällig am 29.01.2026	£	2.400	2.509
EP Infrastructure A/S 1,816 % fällig am 02.03.2031	€	3.400	2.431
Schaeffler AG 3,375 % fällig am 12.10.2028		2.700	2.413
France Government International Bond 4,250 % fällig am 25.10.2023		2.350	2.356
INEOS Quattro Finance PLC 2,500 % fällig am 15.01.2026		2.500	2.270
BCP Modular Services Finance PLC 4,750 % fällig am 30.11.2028		2.700	2.252
Telecom Italia SpA 6,875 % fällig am 15.02.2028		2.200	2.204
Virgin Media Secured Finance PLC 4,250 % fällig am 15.01.2030	£	2.400	2.194
France Government International Bond 1,750 % fällig am 25.05.2023	€	2.150	2.145
Bellis Acquisition Co. PLC 3,250 % fällig am 16.02.2026	£	2.200	2.079
Forvia 2,750 % fällig am 15.02.2027	€	2.200	1.970
Renault S.A. 2,375 % fällig am 25.05.2026		2.100	1.929
Standard Industries, Inc. 2,250 % fällig am 21.11.2026		2.100	1.841
Nexi SpA 2,125 % fällig am 30.04.2029		2.200	1.836
Lottomatica SpA 7,125 % fällig am 01.06.2028		1.800	1.800
Rolls-Royce PLC 3,375 % fällig am 18.06.2026	£	1.580	1.623
Chemours Co. 4,000 % fällig am 15.05.2026	€	1.700	1.581
Kronos International, Inc. 3,750 % fällig am 15.09.2025		1.700	1.568
Commerzbank AG 8,625 % fällig am 28.02.2033	£	1.300	1.533
Teva Pharmaceutical Finance Netherlands BV 1,875 % fällig am 31.03.2027	€	1.700	1.437
Kennedy Wilson Europe Real Estate Ltd. 3,250 % fällig am 12.11.2025		1.600	1.415
ProGroup AG 3,000 % fällig am 31.03.2026		1.500	1.410
Banca Monte dei Paschi di Siena SpA 6,750 % fällig am 02.03.2026		1.400	1.401

BESCHREIBUNG		PAR (000S)	ERLÖSE (000S)
VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2023			
Ford Motor Credit Co. LLC 4,867 % fällig am 03.08.2027	€	4.150	€ 4.071
Ford Motor Credit Co. LLC 3,625 % fällig am 17.06.2031	$	3.100	2.298
Rolls-Royce PLC 4,625 % fällig am 16.02.2026	€	2.100	2.061
Adient Global Holdings Ltd. 3,500 % fällig am 15.08.2024		1.900	1.865
Lottomatica SpA 7,125 % fällig am 01.06.2028		1.800	1.853
Cirsa Finance International SARL 4,750 % fällig am 22.05.2025		1.800	1.761
Intrum AB 9,250 % fällig am 15.03.2028		1.800	1.754
France Government International Bond 1,750 % fällig am 25.05.2023		1.700	1.698
EP Infrastructure A/S 1,698 % fällig am 30.07.2026		1.900	1.635
INEOS Quattro Finance Plc 3,375 % fällig am 15.01.2026	$	1.900	1.584
Summer BC Holdco SARL 5,750 % fällig am 31.10.2026	€	1.700	1.484
BCP Modular Services Finance PLC 4,750 % fällig am 30.11.2028		1.500	1.251
Inter Media and Communication SpA 6,750 % fällig am 09.02.2027		1.300	1.225
Cellnex Finance Co. S.A. 1,500 % fällig am 08.06.2028		1.400	1.194
EnQuest PLC 11,625 % fällig am 01.11.2027	$	1.300	1.113
Rossini SARL 6,750 % fällig am 30.10.2025	€	1.000	1.011
Bank of Ireland Group PLC 7,500 % fällig am 19.05.2025		1.000	935
Mundys SpA 1,875 % fällig am 12.02.2028		1.100	925
Axalta Coating Systems Dutch Holding BV 3,750 % fällig am 15.01.2025		900	887
Virgin Money UK PLC 9,250 % fällig am 08.06.2024	£	800	863
Teva Pharmaceutical Finance Netherlands BV 1,875 % fällig am 31.03.2027	€	1.000	850
Accor S.A. 2,375 % fällig am 29.11.2028		900	811
Lloyds Banking Group PLC 8,500 % fällig am 27.03.2028	£	800	808
Loxam S.A.S. 3,250 % fällig am 14.01.2025	€	800	781

(a) Der PIMCO European High Yield Bond Fund legt in Anteile eines verbundenen Fonds an.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Fondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

BESCHREIBUNG		AKTIEN		KOSTEN (000S)
KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2023				
PIMCO ETFs plc - PIMCO Euro Short Maturity UCITS ETF (a)		157.000	€	15.114
		PAR (000S)		
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,375 % fällig am 15.07.2025 (b)	$	8.375		7.412
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 9,000 % fällig am 01.11.2023	€	2.200		2.296
Spain Government International Bond 2,350 % fällig am 30.07.2033		1.600		1.461
Bundesrepublik Deutschland 4,250 % fällig am 04.07.2039		900		1.143
HSBC Holdings PLC 6,254 % fällig am 09.03.2034	$	1.000		944
Europäische Union 0,300 % fällig am 04.11.2050	€	1.900		897
AMCO - Asset Management Co. SpA 4,625 % fällig am 06.02.2027		900		897
Credit Suisse Schweiz AG 3,390 % fällig am 05.12.2025		900		873
Santander UK Group Holdings PLC 6,534 % fällig am 10.01.2029	$	800		754
United Kingdom Gilt 0,875 % fällig am 31.01.2046	£	1.100		716
Westpac Banking Corp. 3,457 % fällig am 04.04.2025	€	700		700
ING Belgium S.A. 3,375 % fällig am 31.05.2027		700		699
Barclays PLC 7,437 % fällig am 02.11.2033	$	600		606
Royal Bank of Canada 3,607 % fällig am 17.01.2025	€	600		600
Spain Government International Bond 3,550 % fällig am 31.10.2033		590		590
Deutsche Bank AG 3,875 % fällig am 12.02.2024	£	500		553
Banco Santander S.A. 3,727 % fällig am 16.01.2025	€	500		500
Toronto-Dominion Bank 3,879 % fällig am 13.03.2026		500		500
Intesa Sanpaolo SpA 3,625 % fällig am 30.06.2028		500		500
UniCredit SpA 3,375 % fällig am 31.01.2027		500		499
Virgin Money UK PLC 4,625 % fällig am 29.10.2028		500		498

BESCHREIBUNG		AKTIEN		ERLÖSE (000S)
VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2023				
PIMCO ETFs plc - PIMCO Euro Short Maturity UCITS ETF (a)		231.600	€	22.258
		PAR (000S)		
Nordea Kredit Realkreditaktieselskab 1,000 % fällig am 01.10.2050	DKK	30.694		3.046
Jyske Realkredit A/S 1,000 % fällig am 01.10.2050		31.500		2.996
Nordea Kredit Realkreditaktieselskab 1,000 % fällig am 01.10.2050		28.880		2.744
Fraport AG Frankfurt Airport Services Worldwide 1,625 % fällig am 09.07.2024	€	2.400		2.342
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 9,000 % fällig am 01.11.2023		2.200		2.293
UniCredit SpA 7,830 % fällig am 04.12.2023	$	2.050		1.879
Realkredit Danmark A/S 1,000 % fällig am 01.10.2050	DKK	18.682		1.843
Realkredit Danmark A/S 2,000 % fällig am 01.10.2053		17.500		1.840
Caisse d'Amortissement de la Dette Sociale 0,125 % fällig am 15.09.2031	€	2.300		1.831
Realkredit Danmark A/S 3,000 % fällig am 01.10.2053	DKK	13.600		1.619
Crown European Holdings S.A. 2,625 % fällig am 30.09.2024	€	1.400		1.374
Credit Suisse Schweiz AG 3,390 % fällig am 05.12.2025		1.200		1.194
Volkswagen Bank GmbH 1,875 % fällig am 31.01.2024		1.200		1.184
Sparebanken Soer Boligkreditt A/S 3,125 % fällig am 14.11.2025		1.100		1.101
Australia & New Zealand Banking Group Ltd. 3,205 % fällig am 15.11.2024		1.100		1.099
Charles Schwab Corp. 5,609 % fällig am 13.05.2026	$	1.200		1.086
Deutsche Bank AG 4,000 % fällig am 29.11.2027	€	1.100		1.082
Royal Bank of Canada 4,784 % fällig am 12.12.2025	$	1.100		1.023
Sprint LLC 7,875 % fällig am 15.09.2023		1.000		945
AMCO - Asset Management Co. SpA 4,625 % fällig am 06.02.2027	€	900		909
Europäische Union 0,300 % fällig am 04.11.2050		1.900		899
Highland Holdings SARL 0,000 % fällig am 12.11.2023		900		877
Nordea Kredit Realkreditaktieselskab 1,500 % fällig am 01.10.2050	DKK	8.700		864
Nykredit Realkredit A/S 3,500 % fällig am 01.10.2053		6.786		844
UBS Group AG 1,250 % fällig am 17.07.2025	€	900		809
Nykredit Realkredit A/S 2,000 % fällig am 01.10.2053	DKK	7.200		789

(a) Der PIMCO European Short-Term Opportunities Fund legt in Anteile eines verbundenen Fonds an.

(b) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Fondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

BESCHREIBUNG		AKTIEN		KOSTEN (000S)
KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2023				
PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)		8.704.172	$	86.675
		PAR (000S)		
Japan Government International Bond 0,005 % fällig am 01.10.2024	¥	1.050.000		7.902
Hungary Treasury Bills 0,000 % fällig am 20.04.2023	HUF	1.653.000		4.830
Hungary Treasury Bills 0,000 % fällig am 13.04.2023		1.647.000		4.747
Canadian Government Real Return Bond 3,500 % fällig am 01.03.2028	CAD	5.500		4.134
South Korea Government International Bond 4,250 % fällig am 10.12.2032	KRW	4.950.810		4.050
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 1,125 % fällig am 15.01.2033 (b)	$	3.824		3.800
U.S. Treasury Bonds 4,000 % fällig am 15.11.2042		3.400		3.509
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,250 % fällig am 15.01.2025 (b)		3.275		3.189
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.04.2025 (b)		3.061		2.963
Bulgaria Government International Bond 4,500 % fällig am 27.01.2033	€	2.100		2.219
Israel Government International Bond 4,500 % fällig am 17.01.2033	$	2.200		2.178
South Korea Government International Bond 3,250 % fällig am 10.06.2033	KRW	2.805.850		2.105
Magyar Export-Import Bank 6,125 % fällig am 04.12.2027	$	2.100		2.084
Canada Government International Bond 1,750 % fällig am 01.12.2053	CAD	3.750		2.077
Colombia Government International Bond 7,500 % fällig am 02.02.2034	$	1.900		1.886
Canadian Government Real Return Bond 2,750 % fällig am 01.06.2033	CAD	2.180		1.551
Hungary Government International Bond 6,250 % fällig am 22.09.2032	$	1.500		1.502
Gaci First Investment Co. 4,875 % fällig am 14.02.2035		1.500		1.466
U.S. Treasury Notes 3,625 % fällig am 31.03.2028		1.400		1.406

BESCHREIBUNG		AKTIEN		ERLÖSE (000S)
VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2023				
PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)		8.365.588	$	83.300
		PAR (000S)		
Canadian Government Real Return Bond 3,500 % fällig am 01.03.2028	CAD	5.500		4.137
U.S. Treasury Bonds 4,000 % fällig am 15.11.2042	$	3.400		3.512
U.S. Treasury Bonds 1,875 % fällig am 15.02.2041		4.500		3.378
Peru Government International Bond 5,940 % fällig am 12.02.2029	PEN	9.000		2.157
Canada Government International Bond 1,750 % fällig am 01.12.2053	CAD	3.750		1.965
Canadian Government Real Return Bond 2,750 % fällig am 01.06.2033		2.180		1.554
Morocco Government International Bond 2,000 % fällig am 30.09.2030	€	1.800		1.530
UBS Group AG 4,703 % fällig am 05.08.2027	$	1.500		1.457
American Municipal Power, Inc. 7,334 % fällig am 15.02.2028		1.300		1.411
U.S. Treasury Notes 3,625 % fällig am 31.03.2028		1.400		1.399
Japan Finance Organization for Municipalities 3,375 % fällig am 27.09.2023		1.400		1.383
Serbia Government International Bond 3,125 % fällig am 15.05.2027	€	1.400		1.376
Madison Park Funding Ltd. 6,010 % fällig am 15.04.2029	$	1.240		1.226
Citigroup, Inc. 3,785 % fällig am 17.03.2033		1.300		1.157
Petroleos Mexicanos 6,750 % fällig am 21.09.2047		1.809		1.105
Santander UK Group Holdings PLC 4,750 % fällig am 15.09.2025		1.100		1.062
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.01.2031 (b)		1.154		1.061
Israel Electric Corp. Ltd. 3,750 % fällig am 22.02.2032		1.200		1.040
Boeing Co. 2,750 % fällig am 01.02.2026		1.000		944

(a) Der Global Advantage Fund legt in Anteile eines verbundenen Fonds an.

(b) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Fondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des Global Bond Fund

BESCHREIBUNG		AKTIEN		KOSTEN (000S)
KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2023				
PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)		60.602.158	$	603.449
		PAR (000S)		
Japan Treasury Bills 0,000 % fällig am 17.04.2023	¥	31.160.000		244.445
Canadian Government Real Return Bond 3,500 % fällig am 01.03.2028	CAD	264.600		197.730
Canadian Government Real Return Bond 1,500 % fällig am 01.06.2031		223.959		148.531
South Korea Government International Bond 4,250 % fällig am 10.12.2032	KRW	166.494.540		136.110
Japan Government International Bond 0,005 % fällig am 01.10.2024	¥	17.912.450		134.182
Japan Government International Bond 0,005 % fällig am 01.03.2024		15.550.000		120.544
Canadian Government Real Return Bond 2,750 % fällig am 01.09.2027	CAD	143.300		106.280
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,250 % fällig am 15.01.2025 (b)	$	98.484		95.885
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 1,125 % fällig am 15.01.2033 (b)		92.408		91.612
U.S. Treasury Bonds 4,000 % fällig am 15.11.2042		88.200		91.022
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.04.2025 (b)		90.376		87.460
Canada Government International Bond 1,750 % fällig am 01.12.2053	CAD	149.130		83.867
South Korea Government International Bond 3,250 % fällig am 10.06.2033	KRW	102.355.980		76.910
Japan Government International Bond 0,005 % fällig am 01.04.2024	¥	8.140.000		62.516
Canadian Government Real Return Bond 2,750 % fällig am 01.06.2033	CAD	79.050		56.296
Japan Government International Bond 0,005 % fällig am 01.05.2024	¥	5.580.000		42.040
Nykredit Realkredit A/S 5,000 % fällig am 01.10.2053	DKK	250.000		35.975
Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc. 5,520 % fällig am 13.01.2028	$	35.700		35.700
U.S. Treasury Notes 3,625 % fällig am 31.03.2028		35.400		35.551
Saudi Arabia Government International Bond 4,875 % fällig am 18.07.2033		32.700		32.314

BESCHREIBUNG		AKTIEN		ERLÖSE (000S)
VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2023				
PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)		48.998.920	$	487.900
		PAR (000S)		
Canadian Government Real Return Bond 3,500 % fällig am 01.03.2028	CAD	264.600		198.050
Canadian Government Real Return Bond 1,500 % fällig am 01.06.2031		223.959		148.630
Canadian Government Real Return Bond 2,750 % fällig am 01.09.2027		143.300		106.340
U.S. Treasury Bonds 4,000 % fällig am 15.11.2042	$	88.200		91.067
U.S. Treasury Bonds 1,875 % fällig am 15.02.2041		114.700		86.089
Canada Government International Bond 1,750 % fällig am 01.12.2053	CAD	149.130		79.520
Canadian Government Real Return Bond 2,750 % fällig am 01.06.2033		79.050		56.360
U.S. Treasury Notes 3,625 % fällig am 31.03.2028	$	35.400		35.386
Boeing Co. 1,950 % fällig am 01.02.2024		36.000		34.888
CBAM Ltd. 6,370 % fällig am 20.10.2029		27.151		26.947
South Korea Government International Bond 3,250 % fällig am 10.06.2033	KRW	34.132.210		25.933
Thailand Government International Bond 3,450 % fällig am 17.06.2043	THB	793.970		25.139
Prudential Funding Asia PLC 2,950 % fällig am 03.11.2033	$	24.600		20.708
Japan Finance Organization for Municipalities 3,375 % fällig am 27.09.2023		20.000		19.754
UBS Group AG 5,959 % fällig am 12.01.2034		17.900		17.918
BNP Paribas S.A. 2,591 % fällig am 20.01.2028		19.553		17.341
Boeing Co. 3,625 % fällig am 01.02.2031		19.000		16.986
Nissan Motor Co. Ltd. 4,810 % fällig am 17.09.2030		18.200		15.925
Nissan Motor Co. Ltd. 4,345 % fällig am 17.09.2027		16.780		15.656

(a) Der Global Bond Fund legt in Anteile eines verbundenen Fonds an.

(b) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Fondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des Global Bond ESG Fund

30. Juni 2023

BESCHREIBUNG		PAR (000S)		KOSTEN (000S)
KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2023				
Japan Treasury Bills 0,000 % fällig am 17.04.2023	¥	16.560.000	$	129.911
Uniform Mortgage-Backed Security 5,000 % fällig am 01.04.2053	$	51.995		51.858
Japan Government International Bond 0,005 % fällig am 01.10.2024	¥	6.820.000		51.185
Uniform Mortgage-Backed Security 5,500 % fällig am 01.05.2053	$	47.995		48.440
Canadian Government Real Return Bond 1,500 % fällig am 01.06.2031	CAD	63.552		42.126
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 1,125 % fällig am 15.01.2033 (b)	$	34.323		34.153
Japan Government International Bond 0,005 % fällig am 01.03.2024	¥	4.110.000		31.831
South Korea Government International Bond 3,250 % fällig am 10.06.2033	KRW	36.353.420		27.444
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,250 % fällig am 15.01.2025 (b)	$	26.580		25.880
Jyske Realkredit A/S 1,000 % fällig am 01.10.2023	DKK	180.000		25.801
Canadian Government Real Return Bond 2,750 % fällig am 01.06.2033	CAD	35.830		25.510
Uniform Mortgage-Backed Security 6,000 % fällig am 01.01.2053	$	24.453		24.989
Canadian Government Real Return Bond 3,500 % fällig am 01.03.2028	CAD	31.800		23.900
South Korea Government International Bond 2,000 % fällig am 10.06.2031	KRW	34.358.800		23.680
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.04.2025 (b)	$	24.374		23.595
Nykredit Realkredit A/S 1,000 % fällig am 01.04.2024	DKK	160.400		22.889
Uniform Mortgage-Backed Security 6,500 % fällig am 01.01.2053	$	21.826		22.365
Canada Government International Bond 1,750 % fällig am 01.12.2053	CAD	39.460		22.116
South Korea Government International Bond 4,250 % fällig am 10.12.2032	KRW	26.799.020		21.926
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 4,000 % fällig am 30.10.2031	€	20.000		21.914
Uniform Mortgage-Backed Security 5,500 % fällig am 01.05.2053	$	18.618		18.790
Hana Bank 3,750 % fällig am 04.05.2026	€	16.200		17.878
Communaute Francaise de Belgique 3,750 % fällig am 22.06.2033		16.300		17.220
Uniform Mortgage-Backed Security 5,000 % fällig am 01.05.2053	$	17.198		17.153
Japan Government International Bond 0,100 % fällig am 10.03.2028	¥	2.127.708		16.469

BESCHREIBUNG		PAR (000S)		ERLÖSE (000S)
VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2023				
Canadian Government Real Return Bond 1,500 % fällig am 01.06.2031	CAD	63.552	$	42.161
Canadian Government Real Return Bond 2,750 % fällig am 01.06.2033		35.830		25.542
Canadian Government Real Return Bond 3,500 % fällig am 01.03.2028		31.800		23.916
Canada Government International Bond 1,750 % fällig am 01.12.2053		39.460		20.948
Deutsche Bank AG 1,875 % fällig am 23.02.2028	€	12.300		11.827
Agence Francaise de Developpement 2,875 % fällig am 21.01.2030		9.000		9.644
Communaute Francaise de Belgique 1,625 % fällig am 03.05.2032		10.300		9.247
Morgan Stanley 3,622 % fällig am 01.04.2031	$	9.100		8.232
U.S. Treasury Notes 3,625 % fällig am 31.03.2028		8.100		8.097
Asian Development Bank 1,500 % fällig am 04.05.2028	CAD	11.700		7.854
Marks & Spencer PLC 3,750 % fällig am 19.05.2026	£	7.145		7.798
Province of Ontario 1,550 % fällig am 01.11.2029	CAD	11.600		7.486
Goldman Sachs Group, Inc. 2,650 % fällig am 21.10.2032	$	8.300		6.805
Region of Ile de France 3,050 % fällig am 03.02.2033	€	6.000		6.432
Japan Government International Bond 0,200 % fällig am 20.09.2032	¥	750.000		5.839
		AKTIEN		
PIMCO Funds: Global Investors Series plc - Global Investment Grade Credit ESG Fund (a)		580.000		5.788
		PAR (000S)		
LeasePlan Corp. NV 0,250 % fällig am 23.02.2026	€	5.800		5.652
Thailand Government International Bond 3,450 % fällig am 17.06.2043	THB	177.900		5.624
Canadian Government Real Return Bond 1,500 % fällig am 01.12.2031	CAD	8.500		5.460
Caisse d'Amortissement de la Dette Sociale 2,875 % fällig am 25.05.2027	€	5.000		5.406
Region Wallonne Belgium 1,375 % fällig am 06.04.2032		6.000		5.244
BNP Paribas S.A. 3,132 % fällig am 20.01.2033	$	6.300		5.174
Uniform Mortgage-Backed Security 2,500 % fällig am 01.01.2052		5.819		5.019
Santander UK Group Holdings PLC 4,750 % fällig am 15.09.2025		5.000		4.827
JPMorgan Chase & Co. 4,493 % fällig am 24.03.2031		4.700		4.539
Equinix, Inc. 2,500 % fällig am 15.05.2031		5.500		4.456
Derwent London PLC 1,875 % fällig am 17.11.2031	£	5.000		4.435
HSBC Holdings PLC 1,500 % fällig am 04.12.2024	€	4.100		4.390
Towd Point Mortgage Trust 6,150 % fällig am 25.10.2059	$	4.310		4.289
ZF Finance GmbH 2,000 % fällig am 06.05.2027	€	4.400		3.998
BNP Paribas S.A. 5,198 % fällig am 10.01.2030	$	4.150		3.996
American Medical Systems Europe BV 0,750 % fällig am 08.03.2025	€	3.800		3.912
International Development Association 1,750 % fällig am 05.05.2037		4.000		3.707
Vonovia SE 0,750 % fällig am 01.09.2032		4.900		3.619

(a) Der Global Bond ESG Fund legt in Anteile eines verbundenen Fonds an.

(b) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Fondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

BESCHREIBUNG		AKTIEN		KOSTEN (000S)
KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2023				
PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)		23.021.423	$	229.243
		PAR (000S)		
Japan Treasury Bills 0,000 % fällig am 17.04.2023	¥	2.880.000		22.593
China Government International Bond 2,440 % fällig am 15.10.2027	CNY	149.740		21.921
Canadian Government Real Return Bond 1,500 % fällig am 01.06.2031	CAD	24.958		16.215
Japan Government International Bond 0,005 % fällig am 01.10.2024	¥	1.320.000		9.878
South Korea Government International Bond 4,250 % fällig am 10.12.2032	KRW	10.509.430		8.589
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,250 % fällig am 15.01.2025 (b)	$	5.920		5.764
Canadian Government Real Return Bond 3,500 % fällig am 01.03.2028	CAD	7.300		5.487
Canadian Government Real Return Bond 2,750 % fällig am 01.06.2033		7.670		5.472
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.04.2025 (b)	$	5.487		5.312
Japan Government International Bond 0,005 % fällig am 01.04.2024	¥	690.000		5.304
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 1,125 % fällig am 15.01.2033 (b)	$	5.339		5.302
South Korea Government International Bond 3,250 % fällig am 10.06.2033	KRW	6.805.960		5.118
Japan Government International Bond 0,005 % fällig am 01.03.2024	¥	620.000		4.816
Canada Government International Bond 1,750 % fällig am 01.12.2053	CAD	7.750		4.378
Japan Government International Bond 0,005 % fällig am 01.05.2024	¥	310.000		2.336
Malaysia Government International Bond 3,885 % fällig am 15.08.2029	MYR	10.179		2.335
Barclays PLC 6,224 % fällig am 09.05.2034	$	2.300		2.300
Saudi Arabia Government International Bond 4,875 % fällig am 18.07.2033		2.200		2.174
Saudi Arabia Government International Bond 4,750 % fällig am 18.01.2028		1.900		1.893

BESCHREIBUNG		AKTIEN		ERLÖSE (000S)
VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2023				
PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)		22.735.689	$	226.400
		PAR (000S)		
Canadian Government Real Return Bond 1,500 % fällig am 01.06.2031	CAD	24.958		16.228
Canadian Government Real Return Bond 3,500 % fällig am 01.03.2028		7.300		5.490
Canadian Government Real Return Bond 2,750 % fällig am 01.06.2033		7.670		5.476
China Government International Bond 3,810 % fällig am 14.09.2050	CNY	24.300		3.921
Canada Government International Bond 1,750 % fällig am 01.12.2053	CAD	6.700		3.603
Canada Government International Bond 2,000 % fällig am 01.12.2051		6.150		3.455
Thailand Government International Bond 3,450 % fällig am 17.06.2043	THB	109.900		3.392
Oracle Corp. 2,300 % fällig am 25.03.2028	$	2.400		2.143
Boeing Co. 2,750 % fällig am 01.02.2026		2.100		1.980
Peru Government International Bond 6,350 % fällig am 12.08.2028	PEN	7.900		1.954
U.S. Treasury Notes 3,625 % fällig am 31.03.2028	$	1.800		1.799
Japan Finance Organization for Municipalities 3,375 % fällig am 27.09.2023		1.800		1.778
Commerzbank AG 5,125 % fällig am 18.01.2030	€	1.600		1.715
South Korea Government International Bond 3,250 % fällig am 10.06.2033	KRW	2.005.660		1.524
Goldman Sachs Group, Inc. 1,375 % fällig am 15.05.2024	€	1.400		1.486
China Government Bond 3,720 % fällig am 12.04.2051	CNY	9.300		1.480
IHO Verwaltungs GmbH 8,750 % fällig am 15.05.2028	€	1.300		1.433
CaixaBank S.A. 3,625 % fällig am 14.09.2028		1.800		1.426
Nordea Kredit Realkreditaktieselskab 1,000 % fällig am 01.10.2050	DKK	12.750		1.389

(a) Der Global Bond Ex-US Fund legt in Anteile eines verbundenen Fonds an.

(b) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Fondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

BESCHREIBUNG		AKTIEN		KOSTEN (000S)
KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2023				
PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)		11.209.301	$	111.622
		PAR (000S)		
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 1,125 % fällig am 15.01.2033 (b)	$	39.930		39.441
		AKTIEN		
PIMCO Funds: Global Investors Series plc - PIMCO Capital Securities Fund (a)		725.222		7.476
PIMCO ETFs plc - PIMCO US Dollar Short Maturity UCITS ETF (a)		65.900		6.543
		PAR (000S)		
Colombian TES 13,250 % fällig am 09.02.2033	COP	14.473.700		3.210
		AKTIEN		
Oak Street Health, Inc.		87.200		3.074
Citigroup, Inc.		61.100		2.864
Wells Fargo & Co.		71.700		2.817
Bank of America Corp.		95.800		2.769
JPMorgan Chase & Co.		21.000		2.769
Radius Global Infrastructure, Inc.		93.700		1.362
Sands China Ltd.		257.600		969
Galaxy Entertainment Group Ltd.		136.000		946
Wuliangye Yibin Co Ltd.		30.800		945
H World Group Ltd.		20.000		945
Li Ning Co Ltd.		101.000		945
Trip.com Group Ltd.		25.100		943
ANTA Sports Products Ltd.		62.800		941
Tencent Holdings Ltd.		19.100		938
China Resources Beer Holdings Co Ltd.		120.000		937

BESCHREIBUNG		AKTIEN		ERLÖSE (000S)
VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2023				
PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)		13.127.486	$	130.726
PIMCO ETFs plc - PIMCO US Dollar Short Maturity UCITS ETF (a)		99.700		9.875
		PAR (000S)		
Bonos de la Tesoreria de la Republica en pesos 4,700 % fällig am 01.09.2030	CLP	5.200.000		5.986
South Africa Government International Bond 10,500 % fällig am 21.12.2026	ZAR	80.350		4.961
Colombian TES 13,250 % fällig am 09.02.2033	COP	14.473.700		3.332
		AKTIEN		
Oak Street Health, Inc.		87.200		3.036
Horizon Therapeutics PLC		26.500		2.911
Vertex Pharmaceuticals, Inc.		7.913		2.695
Regeneron Pharmaceuticals, Inc.		3.435		2.627
		PAR (000S)		
Colombian TES 7,750 % fällig am 18.09.2030	COP	13.677.500		2.619
		AKTIEN		
TEGNA, Inc.		168.148		2.606
First Horizon Corp.		161.653		2.592
PNM Resources, Inc.		49.758		2.435
AMETEK, Inc.		16.956		2.430
Humana, Inc.		4.401		2.144
Elevance Health, Inc.		4.621		2.120
		PAR (000S)		
Nissan Motor Co. Ltd. 4,810 % fällig am 17.09.2030	$	2.100		1.859
		AKTIEN		
NetApp, Inc.		26.589		1.817
MasTec, Inc.		17.777		1.689
Eaton Corp. PLC		10.206		1.654

(a) Der PIMCO Global Dividend Fund legt in Anteile eines verbundenen Fonds an.

(b) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Fondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

BESCHREIBUNG		AKTIEN		KOSTEN (000S)
KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2023				
PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)		22.906.892	$	228.105
		PAR (000S)		
Electricite de France S.A. 9,125 % fällig am 15.03.2033	$	26.800		27.399
EP Infrastructure A/S 1,816 % fällig am 02.03.2031	€	28.500		22.495
Cidron Aida Finco SARL 5,000 % fällig am 01.04.2028		17.500		17.159
United Group BV 3,625 % fällig am 15.02.2028		17.330		14.710
Chrome Bidco SASU 3,500 % fällig am 31.05.2028		11.900		10.661
Allegiant Travel Co. 7,250 % fällig am 15.08.2027	$	10.500		10.461
Virgin Media Secured Finance PLC 4,250 % fällig am 15.01.2030	£	10.000		10.301
Venture Global Calcasieu Pass LLC 6,250 % fällig am 15.01.2030	$	10.000		10.000
Market Bidco Finco PLC 5,500 % fällig am 04.11.2027	£	10.300		9.958
Nexi SpA 2,125 % fällig am 30.04.2029	€	10.200		9.309
Venture Global LNG, Inc. 8,375 % fällig am 01.06.2031	$	9.100		9.100
Cirsa Finance International SARL 4,500 % fällig am 15.03.2027	€	9.000		8.903
CT Investment GmbH 5,500 % fällig am 15.04.2026		8.700		8.749
Medline Borrower LP 5,250 % fällig am 01.10.2029	$	9.750		8.313
Kronos International, Inc. 3,750 % fällig am 15.09.2025	€	8.200		8.291
Altice France S.A. 5,500 % fällig am 15.01.2028	$	10.100		7.898
AMC Networks, Inc. 4,750 % fällig am 01.08.2025		8.300		7.633
TK Elevator Midco GmbH 4,375 % fällig am 15.07.2027	€	7.400		7.303
EQM Midstream Partners LP 4,500 % fällig am 15.01.2029	$	8.050		7.249
Grifols S.A. 3,200 % fällig am 01.05.2025	€	6.500		6.819
Grifols Escrow Issuer S.A. 3,875 % fällig am 15.10.2028		7.800		6.781

BESCHREIBUNG		AKTIEN		ERLÖSE (000S)
VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2023				
PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)		30.297.562	$	301.700
		PAR (000S)		
U.S. Treasury Notes 3,875 % fällig am 30.11.2027	$	55.000		55.442
U.S. Treasury Notes 4,125 % fällig am 31.10.2027		28.000		27.928
U.S. Treasury Notes 4,125 % fällig am 30.09.2027		20.000		20.048
Sprint Capital Corp. 8,750 % fällig am 15.03.2032		10.000		12.236
Sprint LLC 7,625 % fällig am 15.02.2025		10.000		10.255
U.S. Treasury Notes 3,500 % fällig am 15.09.2025		10.000		9.865
TMNL Holding BV 3,750 % fällig am 15.01.2029	€	10.000		9.485
Virgin Media Finance PLC 3,750 % fällig am 15.07.2030		10.000		8.789
Occidental Petroleum Corp. 8,875 % fällig am 15.07.2030	$	5.625		6.435
Global Medical Response, Inc. 6,500 % fällig am 01.10.2025		10.000		6.050
Verallia S.A. 1,875 % fällig am 10.11.2031	€	7.000		5.923
Western Midstream Operating LP 5,500 % fällig am 01.02.2050	$	7.000		5.768
Occidental Petroleum Corp. 6,625 % fällig am 01.09.2030		5.000		5.188
Occidental Petroleum Corp. 6,450 % fällig am 15.09.2036		5.000		5.063
Accor S.A. 2,375 % fällig am 29.11.2028	€	5.000		4.897
Occidental Petroleum Corp. 6,200 % fällig am 15.03.2040	$	5.000		4.888
Cheniere Energy, Inc. 4,625 % fällig am 15.10.2028		5.000		4.704
United Group BV 3,125 % fällig am 15.02.2026	€	5.000		4.671
Energizer Gamma Acquisition BV 3,500 % fällig am 30.06.2029		5.000		4.265

(a) Der Global High Yield Bond Fund legt in Anteile eines verbundenen Fonds an.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Fondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

BESCHREIBUNG		AKTIEN		KOSTEN (000S)
KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2023				
PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)		26.069.611	$	259.596
		PAR (000S)		
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 1,500 % fällig am 15.02.2053 (b)	$	96.458		94.054
Saudi Arabia Government International Bond 4,750 % fällig am 18.01.2028		52.000		51.820
Venture Global Calcasieu Pass LLC 6,250 % fällig am 15.01.2030		39.500		39.500
Amgen, Inc. 5,600 % fällig am 02.03.2043		36.650		36.540
UnitedHealth Group, Inc. 5,875 % fällig am 15.02.2053		25.000		27.431
Societe Generale S.A. 6,691 % fällig am 10.01.2034		26.900		27.019
NatWest Group PLC 6,016 % fällig am 02.03.2034		25.900		25.900
Saudi Arabia Government International Bond 4,875 % fällig am 18.07.2033		25.000		24.705
HCA, Inc. 5,500 % fällig am 01.06.2033		22.550		22.535
National Grid PLC 5,809 % fällig am 12.06.2033		21.500		21.639
Kraft Heinz Foods Co. 4,375 % fällig am 01.06.2046		25.000		21.137
Pfizer Investment Enterprises Pte. Ltd. 5,110 % fällig am 19.05.2043		18.100		17.738
Xcel Energy, Inc. 4,600 % fällig am 01.06.2032		18.000		17.031
Duke Energy Corp. 3,850 % fällig am 15.06.2034	€	16.000		16.179
Canada Government International Bond 2,000 % fällig am 01.06.2028	CAD	22.300		15.706
Venture Global LNG, Inc. 8,125 % fällig am 01.06.2028	$	14.700		14.700
Venture Global LNG, Inc. 8,375 % fällig am 01.06.2031		14.500		14.500
UBS Group AG 4,750 % fällig am 17.03.2032	€	12.900		13.568
Comcast Corp. 5,350 % fällig am 15.05.2053	$	13.100		13.044

BESCHREIBUNG		AKTIEN		ERLÖSE (000S)
VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2023				
PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)		24.521.880	$	244.200
		PAR (000S)		
U.S. Treasury Bonds 2,875 % fällig am 15.05.2052	$	130.500		105.970
U.S. Treasury Bonds 1,875 % fällig am 15.11.2051		98.021		64.452
U.S. Treasury Bonds 2,250 % fällig am 15.02.2052		70.400		50.831
Peru Government International Bond 6,350 % fällig am 12.08.2028	PEN	98.387		24.496
Aroundtown S.A. 5,375 % fällig am 21.03.2029	$	31.800		24.377
Bevco Lux SARL 1,500 % fällig am 16.09.2027	€	23.000		22.536
Intesa Sanpaolo SpA 7,750 % fällig am 11.01.2027		22.042		21.886
Crown Castle, Inc. 4,450 % fällig am 15.02.2026	$	20.933		20.730
MH Sub LLC 8,852 % fällig am 13.09.2024		20.277		20.077
Las Vegas Sands Corp. 3,200 % fällig am 08.08.2024		20.000		19.345
American Tower Corp. 2,950 % fällig am 15.01.2025		20.000		19.293
Deutsche Bank AG 1,625 % fällig am 20.01.2027	€	18.600		18.199
Huarong Finance Co. Ltd. 2,125 % fällig am 30.09.2023	$	17.000		16.533
DAE Funding LLC 1,625 % fällig am 15.02.2024		16.400		15.719
Canada Government International Bond 2,000 % fällig am 01.06.2028	CAD	22.300		15.554
Logicor Financing SARL 1,625 % fällig am 15.07.2027	€	17.550		15.535
Carnival Corp. 7,168 % fällig am 30.06.2025		13.966		14.902
QNB Finance Ltd. 3,500 % fällig am 28.03.2024	$	14.500		14.256
MPT Operating Partnership LP 3,692 % fällig am 05.06.2028	£	17.262		14.179

(a) Der Global Investment Grade Credit Fund legt in Anteile eines verbundenen Fonds an.

(b) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Fondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

BESCHREIBUNG		PAR (000S)		KOSTEN (000S)
KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2023				
U.S. Treasury Notes 4,250 % fällig am 31.05.2025	$	30.800	$	30.734
U.S. Treasury Bonds 4,000 % fällig am 15.11.2042		10.900		11.402
Arkea Home Loans SFH S.A. 3,250 % fällig am 01.08.2033	€	9.900		10.524
Uniform Mortgage-Backed Security 4,500 % fällig am 01.12.2052	$	9.993		9.686
Morgan Stanley 5,123 % fällig am 01.02.2029		8.500		8.500
Hana Bank 3,750 % fällig am 04.05.2026	€	7.500		8.282
Uniform Mortgage-Backed Security 4,500 % fällig am 01.05.2053	$	8.513		8.216
Uniform Mortgage-Backed Security 4,000 % fällig am 01.05.2053		8.622		8.122
Nederlandse Waterschapsbank NV 3,000 % fällig am 20.04.2033	€	6.500		7.124
Uniform Mortgage-Backed Security 4,500 % fällig am 01.06.2053	$	7.302		7.054
U.S. Treasury Bonds 3,875 % fällig am 15.05.2043		7.100		6.958
Wisconsin Power & Light Co. 4,950 % fällig am 01.04.2033		6.760		6.843
Morgan Stanley 6,342 % fällig am 18.10.2033		6.000		6.524
Region Wallonne Belgium 3,500 % fällig am 15.03.2043	€	5.800		6.140
Land Securities Capital Markets PLC 4,875 % fällig am 15.09.2034	£	5.000		6.051
Truist Financial Corp. 4,873 % fällig am 26.01.2029	$	6.000		6.000
PNC Financial Services Group, Inc. 4,758 % fällig am 26.01.2027		5.880		5.880
United Kingdom Gilt 3,750 % fällig am 22.10.2053	£	4.700		5.788
JPMorgan Chase & Co. 4,912 % fällig am 25.07.2033	$	5.600		5.547
Barclays PLC 6,224 % fällig am 09.05.2034		5.400		5.400

BESCHREIBUNG		PAR (000S)		ERLÖSE (000S)
VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2023				
U.S. Treasury Bonds 1,750 % fällig am 15.08.2041	$	37.750	$	26.484
U.S. Treasury Bonds 4,000 % fällig am 15.11.2042		8.900		8.840
U.S. Treasury Notes 4,250 % fällig am 15.10.2025		8.000		7.934
U.S. Treasury Bonds 3,250 % fällig am 15.05.2042		6.200		5.617
Nordea Bank Abp 1,500 % fällig am 30.09.2026		6.100		5.329
Apple, Inc. 1,400 % fällig am 05.08.2028		6.100		5.291
Enel Finance International NV 4,625 % fällig am 15.06.2027		5.400		5.243
Zoetis, Inc. 2,000 % fällig am 15.05.2030		6.100		5.067
U.S. Treasury Bonds 2,250 % fällig am 15.05.2041		6.500		4.949
Israel Government International Bond 4,500 % fällig am 17.01.2033		4.400		4.237
Owens Corning 3,875 % fällig am 01.06.2030		4.500		4.191
Forvia 2,750 % fällig am 15.02.2027	€	4.000		3.885
Schaeffler AG 3,375 % fällig am 12.10.2028		3.700		3.571
NextEra Energy Capital Holdings, Inc. 1,900 % fällig am 15.06.2028	$	4.000		3.441
Trane Technologies Financing Ltd. 5,250 % fällig am 03.03.2033		3.300		3.330
Bank of Ireland Group PLC 6,253 % fällig am 16.09.2026		3.250		3.238
Haleon U.S. Capital LLC 3,375 % fällig am 24.03.2029		3.500		3.188
Wells Fargo & Co. 4,540 % fällig am 15.08.2026		3.100		3.055
Cooperatieve Rabobank UA 3,758 % fällig am 06.04.2033		3.450		3.030
Open Text Corp. 6,900 % fällig am 01.12.2027		2.900		2.996
Banco de Sabadell S.A. 0,875 % fällig am 16.06.2028	€	3.400		2.925
KBC Group NV 3,000 % fällig am 25.08.2030		2.900		2.886
Bank of Ireland Group PLC 1,875 % fällig am 05.06.2026		2.900		2.884

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Fondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

BESCHREIBUNG		AKTIEN		KOSTEN (000S)
KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2023				
PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)		26.568.216	$	264.567
		PAR (000S)		
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 1,625 % fällig am 15.10.2027 (b)	$	43.057		43.717
United Kingdom Gilt 1,250 % fällig am 22.11.2027	£	27.902		35.555
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,875 % fällig am 15.01.2029 (b)	$	35.743		34.995
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,750 % fällig am 15.07.2028 (b)		35.666		34.516
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,250 % fällig am 15.01.2025 (b)		35.175		33.944
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,375 % fällig am 15.01.2027 (b)		27.604		26.376
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,625 % fällig am 15.01.2026 (b)		25.015		24.150
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.04.2026 (b)		22.665		21.458
Uniform Mortgage-Backed Security 4,500 % fällig am 01.09.2052		19.993		19.567
France Government International Bond 1,850 % fällig am 25.07.2027	€	13.761		15.973
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.07.2024 (b)	$	15.257		14.989
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2,400 % fällig am 15.05.2039	€	11.147		11.975
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 1,400 % fällig am 26.05.2025		11.357		11.881
United Kingdom Gilt 0,875 % fällig am 22.10.2029	£	11.400		11.544
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,375 % fällig am 15.07.2027 (b)	$	9.856		9.488
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,625 % fällig am 15.07.2032 (b)		6.253		5.846
Ginnie Mae 5,866 % fällig am 20.04.2073		5.700		5.643
Ginnie Mae 5,946 % fällig am 20.03.2073		5.700		5.641
Ginnie Mae 6,067 % fällig am 20.03.2073		5.700		5.631

BESCHREIBUNG		AKTIEN		ERLÖSE (000S)
VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2023				
PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)		27.797.310	$	276.800
		PAR (000S)		
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,500 % fällig am 15.04.2024 (b)	$	62.081		60.566
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,625 % fällig am 15.01.2024 (b)		47.987		47.126
United Kingdom Gilt 0,125 % fällig am 22.03.2026	£	34.928		42.190
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,625 % fällig am 15.04.2023 (b)	$	30.692		30.571
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.04.2026 (b)		26.720		25.271
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.10.2024 (b)		25.502		24.609
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,375 % fällig am 15.01.2027 (b)		20.687		19.531
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.10.2025 (b)		19.026		18.112
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,500 % fällig am 15.01.2028 (b)		17.942		16.952
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,375 % fällig am 15.07.2023 (b)		15.350		15.273
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,625 % fällig am 15.01.2026 (b)		15.829		15.082
United Kingdom Gilt 0,875 % fällig am 22.10.2029	£	11.400		11.573
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,875 % fällig am 15.01.2029 (b)	$	9.970		9.417
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.07.2026 (b)		6.192		5.848
Ginnie Mae 5,946 % fällig am 20.03.2073		5.716		5.657
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,375 % fällig am 15.07.2027 (b)		4.709		4.439
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,375 % fällig am 15.07.2025 (b)		4.602		4.415
France Government International Bond 0,100 % fällig am 25.07.2038	€	3.087		3.023
Nykredit Realkredit A/S 1,500 % fällig am 01.10.2053	DKK	26.900		2.882

(a) Der Global Low Duration Real Return Fund legt in Anteile eines verbundenen Fonds an.

(b) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Fondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

BESCHREIBUNG		AKTIEN		KOSTEN (000S)
KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2023				
PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)		25.429.485	$	253.215
		PAR (000S)		
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,625 % fällig am 15.07.2032 (b)	$	56.233		53.359
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2,400 % fällig am 15.05.2039	€	40.068		43.047
France Government International Bond 0,100 % fällig am 25.07.2031		29.778		31.546
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 1,125 % fällig am 15.01.2033 (b)	$	26.480		25.982
France Government International Bond 1,800 % fällig am 25.07.2040	€	19.094		25.075
United Kingdom Gilt 0,500 % fällig am 31.01.2029	£	22.500		23.421
United Kingdom Gilt 0,875 % fällig am 22.10.2029		20.000		20.426
United Kingdom Gilt 0,625 % fällig am 22.03.2045		16.400		20.327
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.04.2027 (b)	$	15.800		15.126
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,625 % fällig am 15.01.2024 (b)		14.043		13.726
United Kingdom Gilt 1,125 % fällig am 22.11.2037	£	8.330		11.703
France Government International Bond 0,700 % fällig am 25.07.2030	€	9.979		11.439
France Government International Bond 0,550 % fällig am 01.03.2039		9.325		9.842
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,875 % fällig am 15.02.2047 (b)	$	11.327		9.717
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 1,625 % fällig am 15.10.2027 (b)		8.600		8.737
United Kingdom Gilt 4,125 % fällig am 22.07.2030	£	1.900		8.106
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 1,500 % fällig am 15.02.2053 (b)	$	8.079		8.046
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 1,000 % fällig am 15.02.2048 (b)		9.134		7.987
UniCredit SpA 3,375 % fällig am 31.01.2027	€	7.000		7.463
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,500 % fällig am 15.04.2024 (b)	$	7.676		7.459

BESCHREIBUNG		AKTIEN		ERLÖSE (000S)
VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2023				
PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)		25.116.645	$	250.100
		PAR (000S)		
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,625 % fällig am 15.04.2023 (b)	$	68.906		68.858
France Government International Bond 0,100 % fällig am 25.07.2031	€	43.474		47.179
United Kingdom Gilt 1,250 % fällig am 22.11.2032	£	23.576		32.480
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,625 % fällig am 15.07.2032 (b)	$	27.458		25.961
United Kingdom Gilt 0,500 % fällig am 31.01.2029	£	22.500		23.404
United Kingdom Gilt 0,875 % fällig am 22.10.2029		20.000		21.141
Australia Government International Bond 3,000 % fällig am 20.09.2025	AUD	20.720		20.475
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2,550 % fällig am 15.09.2041	€	16.901		19.055
Nykredit Realkredit A/S 1,000 % fällig am 01.10.2050	DKK	173.918		17.741
United Kingdom Gilt 0,125 % fällig am 22.03.2044	£	11.238		12.436
United Kingdom Gilt 0,625 % fällig am 22.11.2042		8.825		11.159
France Government International Bond 0,100 % fällig am 25.07.2038	€	9.945		9.741
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.07.2031 (b)	$	10.415		9.252
United Kingdom Gilt 1,250 % fällig am 22.10.2041	£	10.900		8.878
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,750 % fällig am 15.02.2045 (b)	$	10.593		8.710
Nykredit Realkredit A/S 0,500 % fällig am 01.10.2053	DKK	85.800		8.582
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 1,375 % fällig am 15.02.2044 (b)	$	8.793		8.355
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.04.2027 (b)		7.167		6.702
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.01.2032 (b)		6.756		5.994

(a) Der Global Real Return Fund legt in Anteile eines verbundenen Fonds an.

(b) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Fondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

BESCHREIBUNG		AKTIEN		KOSTEN (000S)
KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2023				
PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)		92.073.080	$	916.871
		PAR (000S)		
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.07.2024 (b)	$	589.185		572.494
U.S. Treasury Notes 0,625 % fällig am 30.11.2027		542.910		471.290
Uniform Mortgage-Backed Security 6,500 % fällig am 01.06.2053		424.378		437.266
Uniform Mortgage-Backed Security 6,500 % fällig am 01.02.2053		418.948		431.590
Uniform Mortgage-Backed Security 6,000 % fällig am 01.02.2053		415.453		423.328
Uniform Mortgage-Backed Security 6,000 % fällig am 01.01.2053		415.060		421.079
Uniform Mortgage-Backed Security 6,000 % fällig am 01.04.2053		381.907		390.432
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,250 % fällig am 15.01.2025 (b)		392.865		378.114
Uniform Mortgage-Backed Security 6,500 % fällig am 01.02.2053		366.898		377.741
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.10.2024 (b)		344.587		333.015
Uniform Mortgage-Backed Security 6,500 % fällig am 01.01.2053		309.361		318.345
Uniform Mortgage-Backed Security 6,000 % fällig am 01.02.2053		306.748		312.487
Uniform Mortgage-Backed Security 6,500 % fällig am 01.01.2053		292.884		301.958
Uniform Mortgage-Backed Security 6,500 % fällig am 01.03.2053		287.921		295.749
Uniform Mortgage-Backed Security 6,000 % fällig am 01.01.2053		256.730		260.624
Uniform Mortgage-Backed Security 5,500 % fällig am 01.01.2053		233.483		234.126
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,625 % fällig am 15.01.2024 (b)		222.145		217.394
Uniform Mortgage-Backed Security 5,500 % fällig am 01.06.2053		216.217		216.570
U.S. Treasury Notes 0,625 % fällig am 31.12.2027		230.260		199.477
Credit Suisse AG 5,500 % fällig am 20.08.2026	€	179.400		190.721
Uniform Mortgage-Backed Security 6,000 % fällig am 01.03.2053	$	171.983		175.667
U.S. Treasury Notes 0,750 % fällig am 31.01.2028		199.210		173.214

BESCHREIBUNG		AKTIEN		ERLÖSE (000S)
VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2023				
PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)		51.790.752	$	515.700
		PAR (000S)		
Uniform Mortgage-Backed Security 3,500 % fällig am 01.05.2052	$	450.387		417.289
Uniform Mortgage-Backed Security 6,500 % fällig am 01.02.2053		220.992		228.485
Uniform Mortgage-Backed Security 6,500 % fällig am 01.02.2053		138.941		143.630
Russia Government International Bond 5,930 % fällig am 24.04.2024	RUB	18.336.201		137.644
Uniform Mortgage-Backed Security 6,500 % fällig am 01.03.2053	$	106.806		110.427
Bank of Ireland Group PLC 7,500 % fällig am 19.05.2025	€	102.118		108.139
Uniform Mortgage-Backed Security 6,500 % fällig am 01.04.2053	$	89.372		92.388
Ginnie Mae 3,500 % fällig am 20.09.2052		99.336		92.165
Barclays PLC 7,125 % fällig am 15.06.2025	£	70.960		79.719
Boeing Co. 5,805 % fällig am 01.05.2050	$	66.762		66.186
		AKTIEN		
Noble Corp. PLC		1.786.917		65.526
		PAR (000S)		
Netflix, Inc. 4,625 % fällig am 15.05.2029	€	58.400		64.385
Hilton Domestic Operating Co., Inc. 6,939 % fällig am 22.06.2026	$	64.007		63.925
Fannie Mae 6,500 % fällig am 01.04.2053		61.117		63.189
Mundys SpA 1,875 % fällig am 12.02.2028	€	68.400		63.002
Freddie Mac 3,000 % fällig am 01.08.2037	$	63.747		61.123
Petroleos Mexicanos 6,700 % fällig am 16.02.2032		79.586		59.758
Rolls-Royce PLC 4,625 % fällig am 16.02.2026	€	54.919		58.618
SkyMiles IP Ltd. 8,798 % fällig am 20.10.2027	$	55.315		57.312

(a) Der Income Fund legt in Anteile eines verbundenen Fonds an.

(b) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Fondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des Income Fund II

BESCHREIBUNG		AKTIEN		KOSTEN (000S)
KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2023				
PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)		6.072.281	$	60.466
		PAR (000S)		
Uniform Mortgage-Backed Security 6,500 % fällig am 01.02.2053	$	5.550		5.741
U.S. Treasury Notes 3,875 % fällig am 31.12.2027		4.600		4.640
Uniform Mortgage-Backed Security 4,000 % fällig am 01.04.2053		4.800		4.490
Uniform Mortgage-Backed Security 5,500 % fällig am 01.03.2053		4.000		4.022
Uniform Mortgage-Backed Security 4,500 % fällig am 01.10.2052		3.800		3.706
Great Hall Mortgages PLC 5,282 % fällig am 18.06.2038	£	2.960		3.436
Uniform Mortgage-Backed Security 4,000 % fällig am 01.03.2053	$	3.100		2.915
Uniform Mortgage-Backed Security 3,500 % fällig am 01.02.2053		3.182		2.906
U.S. Treasury Notes 4,125 % fällig am 15.11.2032		2.400		2.513
Uniform Mortgage-Backed Security 5,000 % fällig am 01.01.2053		2.479		2.470
Uniform Mortgage-Backed Security 6,000 % fällig am 01.04.2053		1.798		1.829
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.07.2024 (b)		1.539		1.495
Eurosail PLC 3,919 % fällig am 13.03.2045	€	1.500		1.349
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,250 % fällig am 15.01.2025 (b)	$	1.274		1.227
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.10.2024 (b)		1.247		1.205
Stratton Mortgage Funding PLC 6,991 % fällig am 20.07.2060	£	1.000		1.184
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,625 % fällig am 15.07.2032 (b)	$	1.229		1.154
U.S. Treasury Notes 3,500 % fällig am 31.01.2028		1.100		1.069
Jupiter Mortgage PLC 8,241 % fällig am 20.07.2060	£	900		1.002

BESCHREIBUNG		AKTIEN		ERLÖSE (000S)
VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2023				
PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)		5.483.190	$	54.600
		PAR (000S)		
Uniform Mortgage-Backed Security 6,500 % fällig am 01.02.2053	$	5.244		5.407
U.S. Treasury Notes 4,125 % fällig am 15.11.2032		4.200		4.462
U.S. Treasury Notes 3,875 % fällig am 31.12.2027		3.000		3.064
U.S. Treasury Notes 2,750 % fällig am 15.05.2025		2.500		2.453
U.S. Treasury Notes 4,000 % fällig am 31.10.2029		1.700		1.729
Stratton Mortgage Funding PLC 6,991 % fällig am 20.07.2060	£	1.000		1.210
U.S. Treasury Notes 3,875 % fällig am 30.09.2029	$	700		707
HSBC Holdings PLC 6,254 % fällig am 09.03.2034		600		624
Eurosail PLC 3,766 % fällig am 15.12.2044	€	504		531
UniCredit SpA 3,875 % fällig am 03.06.2027		500		382
Intesa Sanpaolo SpA 5,875 % fällig am 01.09.2031		300		255
Dryden Euro CLO DAC 3,987 % fällig am 15.01.2032		239		251
Mortimer BTL PLC 4,234 % fällig am 21.06.2052	£	200		245
Huarong Finance Co. Ltd. 3,375 % fällig am 24.02.2030	$	300		237
Segovia European CLO DAC 4,080 % fällig am 20.07.2032	€	200		209
Russia Government International Bond 4,875 % fällig am 16.09.2023	$	200		180
Peru Government International Bond 6,900 % fällig am 12.08.2037	PEN	500		121
Amgen, Inc. 5,650 % fällig am 02.03.2053	$	100		103
South Africa Government International Bond 10,500 % fällig am 21.12.2026	ZAR	240		15

(a) Der Income Fund II legt in Anteile eines verbundenen Fonds an.

(b) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Fondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

BESCHREIBUNG		AKTIEN		KOSTEN (000S)
KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2023				
PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)		5.295.849	$	52.735
Invesco Physical Gold ETC		83.600		15.496
		PAR (000S)		
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,625 % fällig am 15.07.2032 (b)	$	9.336		8.847
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 1,125 % fällig am 15.01.2033 (b)		7.374		7.251
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 0,100 % fällig am 15.05.2033	€	6.158		5.442
Ginnie Mae 5,966 % fällig am 20.01.2073	$	4.000		4.000
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 1,400 % fällig am 26.05.2025	€	3.751		3.924
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 1,500 % fällig am 15.02.2053 (b)	$	2.626		2.614
		AKTIEN		
Prologis, Inc.		9.840		1.180
Equinix, Inc.		1.256		887
Public Storage		1.973		577
Realty Income Corp.		9.136		576
Simon Property Group, Inc.		5.099		555
		PAR (000S)		
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 1,625 % fällig am 15.10.2027 (b)	$	506		513
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,625 % fällig am 15.01.2024 (b)		511		499
		AKTIEN		
Invitation Homes, Inc.		13.911		432
AvalonBay Communities, Inc.		2.440		405
Oak Street Health, Inc.		11.000		388
Gaming and Leisure Properties, Inc.		6.993		351
Digital Realty Trust, Inc.		3.384		348

BESCHREIBUNG		AKTIEN		ERLÖSE (000S)
VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2023				
PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)		6.003.816	$	59.781
		PAR (000S)		
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,625 % fällig am 15.07.2032 (b)	$	38.637		36.609
		AKTIEN		
Invesco Physical Gold ETC		73.541		13.892
		PAR (000S)		
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 1,125 % fällig am 15.01.2033 (b)	$	7.428		7.171
MRCD Mark Mortgage Trust 2,718 % fällig am 15.12.2036		2.598		2.404
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,750 % fällig am 15.02.2045 (b)		2.675		2.212
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,875 % fällig am 15.02.2047 (b)		2.588		2.206
		AKTIEN		
Invesco Physical Gold ETC		9.670		1.709
		PAR (000S)		
Nykredit Realkredit A/S 1,000 % fällig am 01.10.2050	DKK	15.000		1.619
Realkredit Danmark A/S 1,000 % fällig am 01.10.2050		9.000		964
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,625 % fällig am 15.04.2023 (b)	$	480		476
		AKTIEN		
Nationwide Building Society		2.872		453
		PAR (000S)		
Saudi Arabia Government International Bond 4,000 % fällig am 17.04.2025	$	380		371
Nykredit Realkredit A/S 1,500 % fällig am 01.10.2053	DKK	3.500		361
		AKTIEN		
Prologis, Inc.		2.857		357
Horizon Therapeutics PLC		2.700		269
Public Storage		896		266
Seagen, Inc.		1.275		248
Invitation Homes, Inc.		7.334		248
Prometheus Biosciences, Inc.		1.200		238

(a) Der Inflation Multi-Asset Fund legt in Anteile eines verbundenen Fonds an.

(b) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Fondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

BESCHREIBUNG		PAR (000S)		KOSTEN (000S)
KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2023				
U.S. Treasury Notes 4,250 % fällig am 31.12.2024	$	183.100	$	183.157
		AKTIEN		
PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)		16.160.879		160.926
		PAR (000S)		
U.S. Treasury Notes 0,375 % fällig am 31.01.2026	$	139.800		127.362
U.S. Treasury Notes 3,875 % fällig am 15.01.2026		42.000		41.846
U.S. Treasury Notes 4,125 % fällig am 31.01.2025		38.500		38.285
U.S. Treasury Notes 0,250 % fällig am 31.05.2025		27.900		25.815
U.S. Treasury Notes 4,250 % fällig am 31.05.2025		19.800		19.753
Toronto-Dominion Bank 3,879 % fällig am 13.03.2026	€	6.700		7.155
HSBC Holdings PLC 6,161 % fällig am 09.03.2029	$	5.200		5.200
Ginnie Mae 6,166 % fällig am 20.05.2073		4.325		4.323
Canadian Imperial Bank of Commerce 3,250 % fällig am 31.03.2027	€	3.400		3.651
Freddie Mac 3,590 % fällig am 25.01.2025	$	3.604		3.532
UBS Group AG 5,711 % fällig am 12.01.2027		3.500		3.500
Palmer Square European Loan Funding DAC 4,727 % fällig am 15.11.2032	€	3.250		3.444
Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc. 5,464 % fällig am 13.01.2026	$	3.300		3.300
BPCE S.A. 5,975 % fällig am 18.01.2027		2.900		2.900
Amgen, Inc. 5,250 % fällig am 02.03.2025		2.600		2.601
U.S. Treasury Notes 0,875 % fällig am 31.01.2024		2.500		2.403
American Honda Finance Corp. 5,000 % fällig am 23.05.2025		2.400		2.398
National Bank of Canada 3,500 % fällig am 25.04.2028	€	2.000		2.191

BESCHREIBUNG		PAR (000S)		ERLÖSE (000S)
VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2023				
U.S. Treasury Notes 0,875 % fällig am 31.01.2024	$	193.300	$	185.780
U.S. Treasury Notes 1,500 % fällig am 29.02.2024		190.000		183.439
		AKTIEN		
PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)		16.399.070		163.300
		PAR (000S)		
U.S. Treasury Notes 3,875 % fällig am 15.01.2026	$	42.000		41.467
HSBC Holdings PLC 6,161 % fällig am 09.03.2029		5.200		5.283
JPMorgan Chase & Co. 4,851 % fällig am 25.07.2028		4.300		4.284
UBS Group AG 4,488 % fällig am 12.05.2026		4.000		3.908
Global Payments, Inc. 4,950 % fällig am 15.08.2027		3.800		3.719
ABN AMRO Bank NV 2,375 % fällig am 01.06.2027	€	3.600		3.694
Bank of America Corp. 6,233 % fällig am 23.07.2024	$	3.500		3.500
UBS Group AG 5,711 % fällig am 12.01.2027		3.500		3.477
HSBC Holdings PLC 2,999 % fällig am 10.03.2026		3.600		3.395
Goldman Sachs Group, Inc. 3,000 % fällig am 15.03.2024		3.300		3.226
Deutsche Bank AG 1,000 % fällig am 19.11.2025	€	3.000		3.070
BPCE S.A. 5,975 % fällig am 18.01.2027	$	2.900		2.900
Daimler Truck Finance North America LLC 1,125 % fällig am 14.12.2023		3.000		2.899
Mizuho Financial Group, Inc. 5,414 % fällig am 13.09.2028		2.800		2.801
Deutsche Bank AG 5,589 % fällig am 08.11.2023		2.800		2.791
Chanel Ceres PLC 0,500 % fällig am 31.07.2026	€	2.800		2.690
Bank of America Corp. 4,587 % fällig am 22.09.2026		2.400		2.609

(a) Der Low Average Duration Fund legt in Anteile eines verbundenen Fonds an.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Fondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

BESCHREIBUNG		AKTIEN		KOSTEN (000S)
KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2023				
PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)		14.799.599	$	147.370
		PAR (000S)		
U.S. Treasury Notes 4,125 % fällig am 31.01.2025	$	41.600		41.459
U.S. Treasury Notes 3,875 % fällig am 31.03.2025		16.500		16.504
United Kingdom Gilt 1,625 % fällig am 22.10.2028	£	7.200		7.851
Bundesrepublik Deutschland 2,500 % fällig am 13.03.2025	€	6.700		7.148
U.S. Treasury Notes 4,500 % fällig am 15.11.2025	$	5.100		5.183
Sika Capital BV 3,750 % fällig am 03.11.2026	€	3.800		4.169
Santander Holdings USA, Inc. 6,499 % fällig am 09.03.2029	$	4.000		4.000
SK on Co. Ltd. 5,375 % fällig am 11.05.2026		3.900		3.897
Ford Motor Credit Co. LLC 6,860 % fällig am 05.06.2026	£	2.500		3.006
Morgan Stanley Bank N.A. 4,754 % fällig am 21.04.2026	$	3.000		3.000
Black Hills Corp. 5,950 % fällig am 15.03.2028		3.000		2.997
Credit Suisse AG 7,950 % fällig am 09.01.2025		3.000		2.994
BPCE S.A. 5,975 % fällig am 18.01.2027		2.800		2.800
Kenvue, Inc. 5,500 % fällig am 22.03.2025		2.600		2.615
BMW Canada, Inc. 4,760 % fällig am 10.02.2025	CAD	3.500		2.601
Royal Bank of Canada 4,125 % fällig am 05.07.2028	€	2.300		2.499
Amgen, Inc. 5,250 % fällig am 02.03.2025	$	2.500		2.498
Mizuho Financial Group, Inc. 5,628 % fällig am 13.06.2028	£	2.100		2.493
ING Belgium S.A. 3,375 % fällig am 31.05.2027	€	2.300		2.474

BESCHREIBUNG		AKTIEN		ERLÖSE (000S)
VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2023				
PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)		14.229.718	$	141.700
		PAR (000S)		
U.S. Treasury Notes 2,250 % fällig am 31.03.2024	$	12.100		11.767
SK on Co. Ltd. 5,375 % fällig am 11.05.2026		3.900		3.890
Societe Generale S.A. 4,677 % fällig am 15.06.2027		3.500		3.391
Ford Motor Credit Co. LLC 6,860 % fällig am 05.06.2026	£	2.500		3.115
Volkswagen Financial Services AG 0,000 % fällig am 12.02.2025	€	2.700		2.635
Credit Agricole S.A. 6,570 % fällig am 22.03.2024	$	2.600		2.611
American Airlines, Inc. 5,500 % fällig am 20.04.2026		2.600		2.548
RegionalCare Hospital Partners Holdings, Inc. 9,023 % fällig am 16.11.2025		2.500		2.438
Syngenta Finance NV 3,375 % fällig am 16.04.2026	€	1.900		1.996
Lloyds Banking Group PLC 4,716 % fällig am 11.08.2026	$	1.900		1.874
Standard Chartered PLC 7,767 % fällig am 16.11.2028		1.700		1.850
Banco Santander S.A. 1,500 % fällig am 14.04.2026	£	1.700		1.823
DAE Funding LLC 1,625 % fällig am 15.02.2024	$	1.600		1.534
International Flavors & Fragrances, Inc. 1,800 % fällig am 25.09.2026	€	1.400		1.373
Vantage Towers AG 0,000 % fällig am 31.03.2025		1.300		1.341
Ford Motor Credit Co. LLC 3,021 % fällig am 06.03.2024		1.100		1.168
Siemens Energy Finance BV 4,000 % fällig am 05.04.2026		1.000		1.089
QNB Finance Ltd. 3,500 % fällig am 28.03.2024	$	1.100		1.082
Huarong Finance Co. Ltd. 2,125 % fällig am 30.09.2023		1.100		1.070

(a) Der Low Duration Global Investment Grade Credit Fund legt in Anteile eines verbundenen Fonds an.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Fondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

BESCHREIBUNG		AKTIEN		KOSTEN (000S)
KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2023				
PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)		6.309.071	$	62.826
		PAR (000S)		
Shamrock Residential DAC 4,289 % fällig am 24.01.2061	€	23.831		25.327
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.07.2024 (b)	$	17.535		17.051
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.10.2024 (b)		16.094		15.563
Shamrock Residential DAC 4,439 % fällig am 24.06.2071	€	14.000		14.549
Dutch Property Finance BV 4,168 % fällig am 28.04.2064		12.400		13.348
Shamrock Residential DAC 4,689 % fällig am 24.02.2071		12.335		13.233
Harbour Energy PLC 5,457 % fällig am 28.01.2054	£	10.800		12.739
Twin Bridges PLC 0,000 % fällig am 14.06.2055		10.000		12.427
Atlas Funding PLC 5,937 % fällig am 20.01.2061		10.000		12.399
Kinbane DAC 4,263 % fällig am 25.09.2062	€	11.522		12.268
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,250 % fällig am 15.01.2025 (b)	$	8.421		8.109
INEOS Finance PLC 7,463 % fällig am 08.11.2027	€	7.059		7.508
T-Mobile USA, Inc. 4,800 % fällig am 15.07.2028	$	7.000		6.985
Brants Bridge PLC 0,000 % fällig am 14.06.2066	£	5.300		6.649
Adler Financing SARL 12,500 % fällig am 30.06.2025	€	5.771		5.902
Saxon Asset Securities Trust 5,490 % fällig am 25.10.2046	$	5.136		4.933
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,625 % fällig am 15.01.2024 (b)		4.243		4.153
Credit Suisse AG 5,500 % fällig am 20.08.2026	€	3.200		3.402
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.04.2025 (b)	$	3.511		3.357
NovaStar Mortgage Funding Trust 6,725 % fällig am 25.12.2034		3.509		3.287
Societe Generale S.A. 6,447 % fällig am 12.01.2027		3.200		3.200

BESCHREIBUNG		AKTIEN		ERLÖSE (000S)
VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2023				
PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)		2.313.916	$	23.043
		PAR (000S)		
Dufry One BV 3,625 % fällig am 15.04.2026	CHF	7.394		7.836
Uber Technologies, Inc. 7,500 % fällig am 15.05.2025	$	7.600		7.714
INEOS Finance PLC 7,463 % fällig am 08.11.2027	€	7.059		7.534
American Airlines, Inc. 5,500 % fällig am 20.04.2026	$	6.314		6.181
Wynn Resorts Finance LLC 7,750 % fällig am 15.04.2025		4.404		4.404
Pacific Gas & Electric Co. 3,150 % fällig am 01.01.2026		4.474		4.162
Sprint LLC 7,125 % fällig am 15.06.2024		3.842		3.895
Petco Health & Wellness Co., Inc. 1,000 % fällig am 03.03.2028		3.767		3.738
Bombardier, Inc. 7,500 % fällig am 15.03.2025		3.108		3.108
SkyMiles IP Ltd. 8,798 % fällig am 20.10.2027		2.992		3.100
Rolls-Royce PLC 4,625 % fällig am 16.02.2026	€	2.900		2.975
Uber Technologies, Inc. 8,000 % fällig am 01.11.2026	$	2.585		2.646
Amgen, Inc. 5,150 % fällig am 02.03.2028		2.600		2.644
Wynn Macau Ltd. 5,625 % fällig am 26.08.2028		2.700		2.331
VOC Escrow Ltd. 5,000 % fällig am 15.02.2028		2.600		2.294
UBS AG 5,125 % fällig am 15.05.2024		2.280		2.259
Ford Motor Credit Co. LLC 2,700 % fällig am 10.08.2026		2.600		2.256
PetSmart, Inc. 1,000 % fällig am 11.02.2028		2.132		2.114
Ford Motor Credit Co. LLC 4,535 % fällig am 06.03.2025	£	1.801		2.071
Wynn Las Vegas LLC 5,500 % fällig am 01.03.2025	$	1.733		1.688
Sunshine Luxembourg SARL 9,092 % fällig am 01.10.2026		1.716		1.685
Sands China Ltd. 5,900 % fällig am 08.08.2028		1.700		1.617
Sands China Ltd. 2,800 % fällig am 08.03.2027		1.700		1.483
Broadcom, Inc. 3,469 % fällig am 15.04.2034		1.764		1.456
Weir Group PLC 2,200 % fällig am 13.05.2026		1.600		1.419
HSBC Holdings PLC 4,950 % fällig am 31.03.2030		1.320		1.285

(a) Der Low Duration Income Fund legt in Anteile eines verbundenen Fonds an.

(b) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Fondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

BESCHREIBUNG		AKTIEN		KOSTEN (000S)
KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2023				
PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)		17.697.047	$	176.229
		PAR (000S)		
Hungary Treasury Bills 0,000 % fällig am 20.04.2023	HUF	4.500.000		13.149
Hungary Treasury Bills 0,000 % fällig am 13.04.2023		4.484.000		12.922
Toronto-Dominion Bank 3,879 % fällig am 13.03.2026	€	8.000		8.543
Canadian Imperial Bank of Commerce 3,250 % fällig am 31.03.2027		3.200		3.436
Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd. 3,629 % fällig am 06.04.2026		2.600		2.816
Virginia Electric and Power Co. 3,750 % fällig am 15.05.2027	$	2.900		2.789
Goldman Sachs Group, Inc. 4,223 % fällig am 01.05.2029		2.500		2.371
BPCE S.A. 4,625 % fällig am 12.09.2028		2.500		2.352
HSBC Holdings PLC 6,254 % fällig am 09.03.2034		2.100		2.106
Duke Energy Progress LLC 5,250 % fällig am 15.03.2033		2.000		2.041
Enbridge, Inc. 5,700 % fällig am 08.03.2033		2.000		2.029
AES Corp. 5,450 % fällig am 01.06.2028		2.000		1.978
American Tower Corp. 5,250 % fällig am 15.07.2028		2.000		1.972
Wells Fargo & Co. 4,808 % fällig am 25.07.2028		2.000		1.959
Humana, Inc. 3,700 % fällig am 23.03.2029		2.000		1.844
Mexico Government International Bond 5,400 % fällig am 09.02.2028		1.700		1.697
Bank of America Corp. 4,376 % fällig am 27.04.2028		1.000		963
Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc. 5,242 % fällig am 19.04.2029		600		600

BESCHREIBUNG		AKTIEN		ERLÖSE (000S)
VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2023				
PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)		20.194.397	$	201.100
		PAR (000S)		
Peru Government International Bond 6,350 % fällig am 12.08.2028	PEN	29.700		7.351
Peru Government International Bond 5,940 % fällig am 12.02.2029		27.500		6.597
Bellis Acquisition Co. PLC 3,250 % fällig am 16.02.2026	£	5.200		5.309
Southern California Edison Co. 2,750 % fällig am 01.02.2032	$	5.900		5.034
Nissan Motor Co. Ltd. 4,810 % fällig am 17.09.2030		5.400		4.850
Zayo Group Holdings, Inc. 8,217 % fällig am 09.03.2027		5.627		4.657
Lazard Group LLC 4,500 % fällig am 19.09.2028		4.000		3.852
Volkswagen Financial Services NV 1,125 % fällig am 18.09.2023	£	3.100		3.597
Goldman Sachs Group, Inc. 3,000 % fällig am 15.03.2024	$	3.500		3.409
HSBC Holdings PLC 2,999 % fällig am 10.03.2026		3.600		3.395
CenturyLink, Inc. 7,467 % fällig am 15.03.2027		4.381		3.330
Sagax AB 2,250 % fällig am 13.03.2025	€	2.900		3.004
Kronos Acquisition Holdings, Inc. 1,000 % fällig am 22.12.2026	$	2.542		2.465
Nissan Motor Co. Ltd. 4,345 % fällig am 17.09.2027		2.700		2.458
Hamburg Commercial Bank AG 0,500 % fällig am 22.09.2026	€	2.500		2.429
U.S. Foods, Inc. 7,943 % fällig am 22.11.2028	$	2.413		2.419
Grifols Escrow Issuer S.A. 3,875 % fällig am 15.10.2028	€	2.700		2.273
United Airlines, Inc. 9,292 % fällig am 21.04.2028	$	2.158		2.150
OneMain Finance Corp. 6,125 % fällig am 15.03.2024		2.150		2.102

(a) Der Low Duration Opportunities Fund legt in Anteile eines verbundenen Fonds an.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Fondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

BESCHREIBUNG	PAR (000S)	KOSTEN (000S)
KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2023		
Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd.		
5,500 % fällig am 09.03.2028	$ 200	$ 200
Weyerhaeuser Co.		
4,750 % fällig am 15.05.2026	36	36
AES Corp.		
5,450 % fällig am 01.06.2028	20	20

BESCHREIBUNG	PAR (000S)	ERLÖSE (000S)
VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2023		
Weyerhaeuser Co.		
3,375 % fällig am 09.03.2033	$ 36	$ 31
CommScope, Inc.		
8,443 % fällig am 06.04.2026	20	19
U.S. Foods, Inc.		
7,943 % fällig am 22.11.2028	16	16
CenturyLink, Inc.		
7,467 % fällig am 15.03.2027	20	15

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Fondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

BESCHREIBUNG	AKTIEN		KOSTEN (000S)
KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2023			
Kinder Morgan, Inc.	125.600	$	2.292
Antero Midstream Corp.	107.900		1.154
PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	112.068		1.116
ONEOK, Inc.	12.000		825
Hess Midstream LP 'A'	22.700		613

BESCHREIBUNG	AKTIEN		ERLÖSE (000S)
VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2023			
PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	361.531	$	3.600
Equitrans Midstream Corp.	387.682		3.424
Enbridge, Inc.	62.400		2.421
TC Energy Corp.	44.000		1.781
Pembina Pipeline Corp.	52.900		1.753
Chesapeake Energy Corp.	19.000		1.544
Pioneer Natural Resources Co.	6.200		1.333
Diamondback Energy, Inc.	7.800		1.070
Williams Cos., Inc.	32.100		1.004
EnLink Midstream LLC	67.500		844
Cheniere Energy, Inc.	5.000		765
Targa Resources Corp.	9.700		731
Antero Resources Corp.	26.400		704
ONEOK, Inc.	10.400		598
EQT Corp.	14.100		444
ConocoPhillips	2.300		232

(a) Der PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund legt in Anteile eines verbundenen Fonds an.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Fondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

BESCHREIBUNG		PAR (000S)		KOSTEN (000S)
KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2023				
Uniform Mortgage-Backed Security 5,500 % fällig am 01.01.2053	$	198.308	$	201.259
Freddie Mac 4,500 % fällig am 01.02.2053		198.454		190.027
Uniform Mortgage-Backed Security 4,500 % fällig am 01.10.2052		193.733		189.987
Uniform Mortgage-Backed Security 5,500 % fällig am 01.05.2053		109.386		109.767
Uniform Mortgage-Backed Security 5,000 % fällig am 01.07.2053		100.000		98.254
Uniform Mortgage-Backed Security 4,500 % fällig am 01.04.2053		98.975		96.876
Uniform Mortgage-Backed Security 4,500 % fällig am 01.01.2053		98.116		96.035
Fannie Mae 4,500 % fällig am 01.10.2052		97.237		95.357
Uniform Mortgage-Backed Security 4,000 % fällig am 01.05.2053		94.223		88.632
Uniform Mortgage-Backed Security 5,500 % fällig am 01.02.2053		74.655		75.696
Freddie Mac 4,500 % fällig am 01.01.2053		74.876		73.569
Uniform Mortgage-Backed Security 4,500 % fällig am 01.03.2053		49.662		47.553
Uniform Mortgage-Backed Security 5,000 % fällig am 01.06.2053		14.926		14.880
Uniform Mortgage-Backed Security 6,000 % fällig am 01.05.2053		10.945		11.158
Ginnie Mae 3,500 % fällig am 20.10.2052		8.500		7.872
Chester B1 Issuer PLC 5,766 % fällig am 17.01.2058	£	5.888		7.337
Freddie Mac 4,660 % fällig am 25.01.2031	$	2.200		2.200
Ginnie Mae 3,000 % fällig am 20.04.2050		2.264		2.099
Fannie Mae 4,500 % fällig am 01.11.2032		2.000		2.021
Fannie Mae 4,374 % fällig am 01.02.2028		2.000		1.990

BESCHREIBUNG		PAR (000S)		ERLÖSE (000S)
VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2023				
Uniform Mortgage-Backed Security 5,500 % fällig am 01.01.2053	$	198.308	$	200.349
Freddie Mac 4,500 % fällig am 01.02.2053		197.704		193.854
Uniform Mortgage-Backed Security 4,500 % fällig am 01.10.2052		193.733		185.568
Uniform Mortgage-Backed Security 5,500 % fällig am 01.05.2053		108.295		108.145
Uniform Mortgage-Backed Security 5,000 % fällig am 01.01.2053		99.467		99.750
Uniform Mortgage-Backed Security 4,000 % fällig am 01.12.2052		99.248		94.999
Fannie Mae 4,500 % fällig am 01.10.2052		97.237		93.138
Uniform Mortgage-Backed Security 4,500 % fällig am 01.04.2053		85.000		81.882
Uniform Mortgage-Backed Security 5,500 % fällig am 01.02.2053		74.655		75.424
Freddie Mac 4,500 % fällig am 01.01.2053		74.876		73.347
Fannie Mae 3,000 % fällig am 01.06.2051		21.807		20.043
Fannie Mae 3,000 % fällig am 01.06.2051		21.386		19.656
Fannie Mae 3,000 % fällig am 01.12.2050		15.540		14.283
Cardiff Auto Receivables Securitisation PLC 6,404 % fällig am 21.10.2028	£	11.400		14.067
Trinity Square PLC 5,866 % fällig am 15.07.2059		9.600		11.671
Ashford Hospitality Trust 7,419 % fällig am 15.04.2035	$	12.000		11.475
Fannie Mae 3,000 % fällig am 01.06.2051		11.638		10.697
Stratton Mortgage Funding PLC 5,991 % fällig am 20.07.2060	£	8.100		9.955
Countrywide Asset-Backed Certificates Trust 5,440 % fällig am 25.10.2047	$	10.000		8.588
Long Beach Mortgage Loan Trust 5,470 % fällig am 25.10.2036		22.577		7.462

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Fondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des StocksPLUS™ Fund

BESCHREIBUNG		AKTIEN		KOSTEN (000S)
KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2023				
PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)		7.918.177	$	78.848
		PAR (000S)		
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.07.2024 (b)	$	31.988		31.148
Bumper FR 4,113 % fällig am 27.04.2032	€	14.200		15.378
Jupiter Mortgage PLC 5,291 % fällig am 20.07.2060	£	11.540		14.424
LT Autorahoitus DAC 4,250 % fällig am 17.12.2032	€	12.869		14.113
Silver Arrow Athlon NL BV 4,139 % fällig am 26.04.2031		12.757		13.805
LT Autorahoitus DAC 4,040 % fällig am 18.07.2033		10.400		11.371
U.S. Treasury Notes 0,625 % fällig am 30.11.2027	$	12.800		11.112
Tower Bridge Funding PLC 5,399 % fällig am 21.07.2064	£	7.994		10.073
Hill FL BV 4,050 % fällig am 18.05.2030	€	8.544		9.360
Twin Bridges PLC 5,635 % fällig am 01.12.2055	£	7.588		9.321
U.S. Treasury Notes 0,625 % fällig am 31.12.2027	$	10.700		9.269
Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 4,200 % fällig am 15.07.2046		9.084		9.039
Toronto-Dominion Bank 4,701 % fällig am 05.06.2027		9.000		9.000
WFRBS Commercial Mortgage Trust 3,073 % fällig am 15.06.2046		8.856		8.815
London Wall Mortgage Capital PLC 5,452 % fällig am 15.05.2051	£	6.695		8.227
Hill FL BV 4,110 % fällig am 18.05.2031	€	7.400		8.129
Silver Arrow S.A. 3,768 % fällig am 15.02.2030		7.245		7.926
Towd Point Mortgage Trust 3,750 % fällig am 25.10.2056	$	8.100		7.642
UniCredit SpA 3,375 % fällig am 31.01.2027	€	6.200		6.610
Nykredit Realkredit A/S 5,000 % fällig am 01.10.2053	DKK	42.800		6.126
Sumitomo Mitsui Banking Corp. 3,602 % fällig am 16.02.2026	€	5.000		5.496
Bank of Nova Scotia 3,050 % fällig am 31.10.2024		5.000		5.453
Korea Housing Finance Corp. 0,010 % fällig am 05.02.2025		5.000		5.123
Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 4,218 % fällig am 15.07.2046	$	5.150		5.111
Korea Housing Finance Corp. 0,010 % fällig am 07.07.2025	€	5.000		5.051
Australia & New Zealand Banking Group Ltd. 4,675 % fällig am 15.06.2026	$	5.000		5.000
Hops Hill PLC 0,000 % fällig am 21.12.2055	£	3.400		4.219
American Honda Finance Corp. 5,000 % fällig am 23.05.2025	$	4.100		4.097
Ginkgo Sales Finance 4,113 % fällig am 25.11.2049	€	3.652		4.008
Barclays PLC 5,829 % fällig am 09.05.2027	$	3.900		3.900

BESCHREIBUNG		PAR (000S)		ERLÖSE (000S)
VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2023				
Ripon Mortgages PLC 5,491 % fällig am 28.08.2056	£	12.228	$	14.381
Countrywide Asset-Backed Certificates Trust 6,245 % fällig am 25.04.2036	$	11.300		10.622
		AKTIEN		
PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)		863.561		8.600
		PAR (000S)		
Taurus FR DAC 4,787 % fällig am 22.12.2030	€	7.079		7.500
Stratton Mortgage Funding PLC 5,565 % fällig am 12.12.2043	£	5.578		6.521
Logicor Financing SARL 2,250 % fällig am 13.05.2025	€	6.000		5.851
Quanta Services, Inc. 0,950 % fällig am 01.10.2024	$	6.300		5.813
Frost CMBS DAC 4,533 % fällig am 20.11.2033	€	4.870		4.967
Aroundtown S.A. 5,375 % fällig am 21.03.2029	$	6.500		4.696
Countrywide Asset-Backed Certificates Trust 5,440 % fällig am 25.10.2047		5.400		4.686
Hyatt Hotels Corp. 1,800 % fällig am 01.10.2024		4.600		4.321
Park Place Securities, Inc. 6,080 % fällig am 25.05.2035		4.326		3.899
Deutsche Bank AG 1,375 % fällig am 17.02.2032	€	5.000		3.864
Broadcom, Inc. 4,000 % fällig am 15.04.2029	$	4.000		3.757
Nomura Resecuritization Trust 6,050 % fällig am 25.03.2037		3.691		3.567
Countrywide Asset-Backed Certificates Trust 5,430 % fällig am 25.12.2046		3.353		3.068
RAMP Series Trust 5,510 % fällig am 25.08.2046		3.188		2.879
JPMorgan Mortgage Acquisition Trust 5,590 % fällig am 25.07.2036		3.200		2.845
Option One Mortgage Loan Trust 5,280 % fällig am 25.07.2037		4.220		2.767
Long Beach Mortgage Loan Trust 6,065 % fällig am 25.08.2035		3.000		2.674
Countrywide Alternative Loan Trust 5,347 % fällig am 20.09.2046		2.718		2.636
Home Equity Asset Trust 5,450 % fällig am 25.01.2037		2.936		2.525
European Loan Conduit DAC 4,358 % fällig am 17.02.2030	€	2.293		2.427
Jackson National Life Global Funding 6,242 % fällig am 28.06.2024	$	2.200		2.203
Fremont Home Loan Trust 5,765 % fällig am 25.11.2035		2.400		2.085
245 Park Avenue Trust 3,508 % fällig am 05.06.2037		2.300		2.037
Park Place Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates 6,320 % fällig am 25.03.2035		2.100		1.906
Countrywide Asset-Backed Certificates Trust 7,100 % fällig am 25.08.2035		2.000		1.861
Credit Suisse Mortgage Capital Trust 1,115 % fällig am 25.01.2060		2.174		1.819
Credit Suisse Mortgage Capital Trust 2,688 % fällig am 25.03.2059		1.674		1.622
Nissan Motor Co. Ltd. 4,810 % fällig am 17.09.2030		1.600		1.377

(a) Der StocksPLUS™ Fund legt in Anteile eines verbundenen Fonds an.

(b) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Fondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

BESCHREIBUNG		AKTIEN		KOSTEN (000S)
KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2023				
PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)		41.362	$	412
		PAR (000S)		
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,625 % fällig am 15.07.2032 (b)	$	307		292
Palmer Square European Loan Funding DAC 4,727 % fällig am 15.11.2032	€	100		106
Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 4,200 % fällig am 15.07.2046	$	100		100
CSAIL Commercial Mortgage Trust 3,504 % fällig am 15.06.2057		100		96
WFRBS Commercial Mortgage Trust 3,073 % fällig am 15.06.2046		81		81

BESCHREIBUNG		AKTIEN		ERLÖSE (000S)
VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2023				
PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)		20.084	$	200
		PAR (000S)		
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 1,375 % fällig am 15.02.2044 (b)	$	128		127
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,625 % fällig am 15.07.2032 (b)		103		97
VICI Properties LP 3,750 % fällig am 15.02.2027		100		92
245 Park Avenue Trust 3,508 % fällig am 05.06.2037		100		89
Warnermedia Holdings, Inc. 4,279 % fällig am 15.03.2032		100		88
Nykredit Realkredit A/S 1,500 % fällig am 01.10.2053	DKK	71		8

(a) Der PIMCO StocksPLUS™ AR Fund legt in Anteile eines verbundenen Fonds an.

(b) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Fondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

BESCHREIBUNG		AKTIEN		KOSTEN (000S)
KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2023				
PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)		11.067.226	$	110.199
		PAR (000S)		
UBS Group AG 5,959 % fällig am 12.01.2034	$	3.458		3.463
		AKTIEN		
Coca-Cola Co.		53.447		3.227
ConocoPhillips Co.		19.251		1.969
Amgen, Inc.		7.620		1.817
		PAR (000S)		
Societe Generale S.A. 6,691 % fällig am 10.01.2034	$	1.800		1.806
Amgen, Inc. 5,250 % fällig am 02.03.2033		1.800		1.794
Societe Generale S.A. 6,446 % fällig am 10.01.2029		1.700		1.700
		AKTIEN		
Unilever PLC		30.120		1.640
		PAR (000S)		
U.S. Treasury Notes 0,625 % fällig am 30.11.2027	$	1.860		1.615
		AKTIEN		
PACCAR, Inc.		21.032		1.603
Park Hotels & Resorts, Inc.		110.723		1.435
3M Co.		14.293		1.412
Kimberly-Clark Corp.		10.372		1.407
Iberdrola S.A.		116.097		1.321
AbbVie, Inc.		9.122		1.319
Valero Energy Corp.		10.385		1.318
		PAR (000S)		
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,625 % fällig am 15.01.2024 (b)	$	1.329		1.301
		AKTIEN		
Holcim AG		20.846		1.291
MediaTek, Inc.		49.000		1.201

BESCHREIBUNG		AKTIEN		ERLÖSE (000S)
VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2023				
PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)		11.709.681	$	116.600
		PAR (000S)		
INEOS Finance PLC 7,463 % fällig am 08.11.2027	€	4.307		4.591
GLP Capital LP 4,000 % fällig am 15.01.2031	$	3.748		3.316
Community Health Systems, Inc. 5,625 % fällig am 15.03.2027		3.611		3.121
		AKTIEN		
Philip Morris International, Inc.		27.716		2.584
Merck & Co., Inc.		21.585		2.361
Iberdrola S.A.		166.615		2.125
KDDI Corp.		65.000		2.055
General Dynamics Corp.		8.832		2.041
ConocoPhillips Co.		19.251		1.873
		PAR (000S)		
Amgen, Inc. 5,250 % fällig am 02.03.2033	$	1.800		1.857
Pacific Gas & Electric Co. 3,500 % fällig am 15.06.2025		1.891		1.801
Petroleos Mexicanos 6,700 % fällig am 16.02.2032		2.234		1.677
Turkey Government International Bond 4,250 % fällig am 13.03.2025		1.800		1.667
		AKTIEN		
General Mills, Inc.		19.941		1.609
Exxon Mobil Corp.		14.569		1.560
		PAR (000S)		
Wynn Macau Ltd. 5,125 % fällig am 15.12.2029	$	1.840		1.537
		AKTIEN		
Novartis AG		15.483		1.524
		PAR (000S)		
Russia Government International Bond 5,930 % fällig am 24.04.2024	RUB	187.500		1.408
Avolon TLB Borrower (U.S.) LLC 6,896 % fällig am 15.01.2025	$	1.400		1.396

(a) Der Strategic Income Fund legt in Anteile eines verbundenen Fonds an.

(b) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Fondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

BESCHREIBUNG		AKTIEN		KOSTEN (000S)
KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2023				
PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)		70.671.667	$	703.727
		PAR (000S)		
Uniform Mortgage-Backed Security 5,000 % fällig am 01.04.2053	$	62.864		62.714
Uniform Mortgage-Backed Security 5,000 % fällig am 01.05.2053		40.982		41.034
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,625 % fällig am 15.01.2024 (b)		38.037		37.206
Uniform Mortgage-Backed Security 5,000 % fällig am 01.06.2053		34.340		34.377
U.S. Treasury Bonds 4,000 % fällig am 15.11.2052		30.800		33.069
U.S. Treasury Bonds 3,625 % fällig am 15.02.2053		27.300		27.414
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.10.2024 (b)		21.480		20.693
Uniform Mortgage-Backed Security 5,000 % fällig am 01.05.2053		20.000		19.916
Ginnie Mae 5,966 % fällig am 20.01.2073		17.000		16.983
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,750 % fällig am 15.02.2045 (b)		19.203		16.026
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 1,250 % fällig am 15.04.2028 (b)		13.951		13.543
TP ICAP Finance PLC 7,875 % fällig am 17.04.2030	£	9.800		12.133
U.S. Treasury Bonds 3,875 % fällig am 15.05.2043	$	12.400		12.130
Banc of America Merrill Lynch Commercial Mortgage, Inc. 4,231 % fällig am 15.09.2060		10.900		10.574
Benchmark Mortgage Trust 3,666 % fällig am 15.01.2051		11.100		10.541
Venture Global Calcasieu Pass LLC 6,250 % fällig am 15.01.2030		10.500		10.500
Ginnie Mae 5,966 % fällig am 20.01.2073		9.442		9.440
Mercedes-Benz Finance North America LLC 4,800 % fällig am 30.03.2028		9.300		9.287
Uniform Mortgage-Backed Security 4,500 % fällig am 01.05.2053		9.390		9.219

BESCHREIBUNG		AKTIEN		ERLÖSE (000S)
VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2023				
PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)		74.150.247	$	738.400
		PAR (000S)		
U.S. Treasury Bonds 3,625 % fällig am 15.02.2053	$	27.300		26.208
U.S. Treasury Notes 2,875 % fällig am 15.05.2032		25.000		23.683
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A. 6,000 % fällig am 15.01.2026	€	15.000		15.832
U.S. Treasury Notes 1,875 % fällig am 28.02.2027	$	16.700		15.716
U.S. Treasury Bonds 1,375 % fällig am 15.08.2050		26.000		14.853
U.S. Treasury Bonds 4,000 % fällig am 15.11.2042		13.175		13.817
Logicor Financing SARL 2,250 % fällig am 13.05.2025	€	11.000		10.930
U.S. Treasury Bonds 3,250 % fällig am 15.05.2042	$	11.300		10.519
Goldman Sachs Group, Inc. 5,700 % fällig am 01.11.2024		9.900		10.017
Prologis International Funding S.A. 3,125 % fällig am 01.06.2031	€	10.000		9.978
Deutsche Bank AG 1,000 % fällig am 19.11.2025		10.000		9.937
Digital Intrepid Holding BV 0,625 % fällig am 15.07.2031		10.300		8.167
Equinix, Inc. 1,000 % fällig am 15.09.2025	$	8.600		7.765
Volkswagen Bank GmbH 1,875 % fällig am 31.01.2024	€	7.500		7.765
Syngenta Finance NV 3,375 % fällig am 16.04.2026		7.000		7.358
Tesco Corporate Treasury Services PLC 0,375 % fällig am 27.07.2029		7.400		6.531
Samhallsbyggnadsbolaget i Norden AB 1,125 % fällig am 04.09.2026		7.600		5.736
Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc. 5,710 % fällig am 13.01.2030	$	4.800		5.009
Deutsche Bank AG 1,375 % fällig am 10.06.2026	€	4.450		4.514

(a) Der Total Return Bond Fund legt in Anteile eines verbundenen Fonds an.

(b) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Fondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

BESCHREIBUNG		AKTIEN		KOSTEN (000S)
KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2023				
PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)		14.253.620	$	141.935
		PAR (000S)		
Japan Treasury Bills 0,000 % fällig am 17.04.2023	¥	3.784.000		29.685
CPPIB Capital, Inc. 6,338 % fällig am 11.03.2026	$	11.000		11.240
Federal Home Loan Bank 5,370 % fällig am 21.05.2024		8.500		8.500
Svensk Exportkredit AB 6,090 % fällig am 23.02.2024		8.000		8.065
Federal Home Loan Bank 5,350 % fällig am 17.05.2024		8.000		8.000
Carlyle Global Market Strategies CLO Ltd. 6,400 % fällig am 15.07.2031		5.996		5.939
Morgan Stanley 5,519 % fällig am 25.01.2024		4.500		4.497
Freddie Mac 5,375 % fällig am 24.04.2025		4.300		4.300
Toyota Motor Credit Corp. 5,569 % fällig am 10.01.2025		4.200		4.200
Transpower New Zealand Ltd. 5,750 % fällig am 28.08.2023	AUD	6.000		4.159
Federal Home Loan Bank 5,360 % fällig am 10.05.2024	$	4.000		4.000
Bank of America Corp. 3,550 % fällig am 05.03.2024		4.000		3.994
RELX Capital, Inc. 3,500 % fällig am 16.03.2023		4.000		3.992
Eni SpA 4,000 % fällig am 12.09.2023		4.000		3.973
Thermo Fisher Scientific, Inc. 5,562 % fällig am 18.10.2024		3.800		3.798
Export-Import Bank of Korea 4,628 % fällig am 30.10.2023	AUD	5.700		3.773
Volkswagen Financial Services Australia Pty Ltd. 3,100 % fällig am 17.04.2023		5.000		3.547
Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd. 0,850 % fällig am 25.03.2024	$	3.700		3.517
National Bank of Canada 5,579 % fällig am 06.08.2024		3.500		3.489

BESCHREIBUNG		AKTIEN		ERLÖSE (000S)
VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2023				
PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)		13.426.751	$	133.700
PIMCO ETFs plc - PIMCO US Dollar Short Maturity UCITS ETF (a)		201.340		20.003
		PAR (000S)		
CPPIB Capital, Inc. 6,338 % fällig am 11.03.2026	$	11.000		11.238
Federal Home Loan Bank 5,370 % fällig am 21.05.2024		8.500		8.499
Svensk Exportkredit AB 6,090 % fällig am 23.02.2024		8.000		8.049
Federal Home Loan Bank 5,350 % fällig am 17.05.2024		8.000		7.998
Freddie Mac 5,375 % fällig am 24.04.2025		4.300		4.300
KeyBank N.A. 5,432 % fällig am 03.01.2024		2.000		1.968
Gilead Sciences, Inc. 0,750 % fällig am 29.09.2023		1.900		1.868
Emirate of Abu Dhabi Government International Bond 0,750 % fällig am 02.09.2023		1.500		1.480
Huntington National Bank 6,280 % fällig am 16.05.2025		1.100		1.055
Bank of Nova Scotia 0,550 % fällig am 15.09.2023		1.000		983
Central Japan Railway Co. 3,400 % fällig am 06.09.2023		900		894
Mercedes-Benz Finance North America LLC 5,500 % fällig am 27.11.2024		800		808
MassMutual Global Funding 5,068 % fällig am 02.06.2023		800		800
Mitsubishi Corp. 3,375 % fällig am 23.07.2024		600		588
SK Hynix, Inc. 1,000 % fällig am 19.01.2024		600		581
Duke Energy Corp. 0,260 % fällig am 10.06.2023		500		500
Province of Quebec 5,520 % fällig am 21.05.2024		500		500
Cooperatieve Rabobank UA 1,980 % fällig am 15.12.2027		500		445

(a) Der PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund legt in Anteile eines verbundenen Fonds an.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Fondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

BESCHREIBUNG		PAR (000S)		KOSTEN (000S)
KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2023				
United Kingdom Gilt 1,625 % fällig am 22.10.2028	£	17.700	£	15.897
United Kingdom Gilt 3,500 % fällig am 22.10.2025		14.900		14.650
United Kingdom Gilt 0,125 % fällig am 30.01.2026		14.100		12.761
United Kingdom Gilt 4,250 % fällig am 07.12.2049		4.600		4.754
United Kingdom Gilt 3,750 % fällig am 22.10.2053		3.300		3.082
Credit Suisse AG 7,750 % fällig am 10.03.2026		1.900		1.897
Barclays PLC 6,369 % fällig am 31.01.2031		1.800		1.807
Weir Group PLC 6,875 % fällig am 14.06.2028		1.800		1.796
CPPIB Capital, Inc. 6,000 % fällig am 07.06.2025		1.700		1.698
Royal Bank of Canada 5,000 % fällig am 24.01.2028		1.700		1.696
ENW Finance PLC 4,893 % fällig am 24.11.2032		1.700		1.687
Motability Operations Group PLC 4,875 % fällig am 17.01.2043		1.500		1.495
HSBC Holdings PLC 3,000 % fällig am 22.07.2028		1.400		1.287
Lloyds Banking Group PLC 2,000 % fällig am 12.04.2028		1.400		1.201
BP Capital Markets PLC 5,773 % fällig am 25.05.2038		1.200		1.200
Electricite de France S.A. 5,500 % fällig am 25.01.2035		1.200		1.181
National Grid Electricity Transmission PLC 5,272 % fällig am 18.01.2043		1.100		1.100
BNP Paribas S.A. 5,750 % fällig am 13.06.2032		1.100		1.099
Deutsche Bank AG 6,125 % fällig am 12.12.2030		1.100		1.096
Heathrow Funding Ltd. 2,750 % fällig am 09.08.2051		1.600		1.025

BESCHREIBUNG		PAR (000S)		ERLÖSE (000S)
VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2023				
United Kingdom Gilt 0,125 % fällig am 31.01.2023	£	47.450	£	47.365
		AKTIEN		
PIMCO ETFs plc - PIMCO Sterling Short Maturity UCITS ETF (a)		51.000		5.189
		PAR (000S)		
United Kingdom Gilt 4,250 % fällig am 07.12.2049	£	4.300		4.656
HSBC Holdings PLC 2,625 % fällig am 16.08.2028		1.400		1.270
LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE 1,125 % fällig am 11.02.2027		1.400		1.252
East Japan Railway Co. 1,162 % fällig am 15.09.2028		1.500		1.230
Informa PLC 3,125 % fällig am 05.07.2026		1.345		1.226
Standard Chartered PLC 7,767 % fällig am 16.11.2028	$	1.300		1.159
Rentokil Initial PLC 5,000 % fällig am 27.06.2032	£	1.200		1.121
MPT Operating Partnership LP 2,500 % fällig am 24.03.2026		1.400		1.105
Hamburg Commercial Bank AG 6,250 % fällig am 18.11.2024	€	1.100		1.003
Deutsche Bank AG 1,875 % fällig am 22.12.2028	£	1.200		991
Northumbrian Water Finance PLC 6,375 % fällig am 28.10.2034		950		969
Oracle Corp. 6,150 % fällig am 09.11.2029	$	1.100		954
UBS Group AG 7,375 % fällig am 07.09.2033	£	1.000		946
Commerzbank AG 8,625 % fällig am 28.02.2033		900		905
Heathrow Funding Ltd. 4,625 % fällig am 31.10.2046		1.100		903
Citigroup, Inc. 4,500 % fällig am 03.03.2031		1.000		892
Deutsche Bank AG 6,125 % fällig am 12.12.2030		900		877
Bevco Lux SARL 1,000 % fällig am 16.01.2030	€	1.300		873

(a) Der UK Corporate Bond Fund legt in Anteile eines verbundenen Fonds an.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Fondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

BESCHREIBUNG		PAR (000S)		KOSTEN (000S)
KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2023				
United Kingdom Gilt 1,250 % fällig am 31.07.2051	£	25.300	£	14.813
United Kingdom Gilt 4,250 % fällig am 07.12.2049		3.900		4.031
United Kingdom Gilt 3,750 % fällig am 22.10.2053		2.800		2.615
British Telecommunications PLC 5,750 % fällig am 13.02.2041		2.500		2.372
Cooperatieve Rabobank UA 5,250 % fällig am 23.05.2041		2.050		2.187
National Grid Electricity Transmission PLC 5,272 % fällig am 18.01.2043		2.000		2.000
Walmart, Inc. 5,250 % fällig am 28.09.2035		1.800		1.856
Electricite de France S.A. 5,625 % fällig am 25.01.2053		1.900		1.846
Tesco Corporate Treasury Services PLC 5,500 % fällig am 27.02.2035		1.800		1.785
National Gas Transmission PLC 5,750 % fällig am 05.04.2035		1.850		1.778
United Utilities Water Finance PLC 5,750 % fällig am 26.06.2036		1.700		1.693
Credit Agricole S.A. 4,875 % fällig am 23.10.2029		1.600		1.589
Siemens Financieringsmaatschappij NV 3,750 % fällig am 10.09.2042		1.800		1.509
Walmart, Inc. 5,625 % fällig am 27.03.2034		1.400		1.496
Pfizer, Inc. 2,735 % fällig am 15.06.2043		2.000		1.402
Tesco Property Finance PLC 5,411 % fällig am 13.07.2044		1.449		1.365
Comcast Corp. 1,875 % fällig am 20.02.2036		1.900		1.335
McDonald's Corp. 3,750 % fällig am 31.05.2038		1.600		1.312
Yorkshire Water Finance PLC 5,500 % fällig am 28.04.2035		1.300		1.278
Enel SpA 5,750 % fällig am 22.06.2037		1.300		1.270
Tesco Property Finance PLC 5,744 % fällig am 13.04.2040		1.220		1.211
Diageo Finance PLC 2,750 % fällig am 08.06.2038		1.600		1.204
Southern Water Services Finance Ltd. 3,000 % fällig am 28.05.2037		1.700		1.200
Clarion Funding PLC 1,875 % fällig am 22.01.2035		1.600		1.116
Motability Operations Group PLC 4,875 % fällig am 17.01.2043		1.100		1.098
Deutsche Telekom AG 3,125 % fällig am 06.02.2034		1.300		1.064
Gatwick Funding Ltd. 2,875 % fällig am 05.07.2051		1.800		1.049
Investor AB 5,500 % fällig am 05.05.2037		1.000		1.023

BESCHREIBUNG		PAR (000S)		ERLÖSE (000S)
VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2023				
United Kingdom Gilt 0,125 % fällig am 31.01.2023	£	5.060	£	5.054
United Kingdom Gilt 4,250 % fällig am 07.12.2049		3.900		4.223
Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 0,875 % fällig am 15.09.2026		3.400		3.047
Deutsche Bank AG 1,875 % fällig am 22.12.2028		3.600		2.982
United Kingdom Gilt 4,250 % fällig am 07.12.2046		2.600		2.477
United Kingdom Gilt 1,250 % fällig am 31.07.2051		4.900		2.406
United Kingdom Gilt 1,500 % fällig am 22.07.2047		3.800		2.194
United Kingdom Gilt 4,250 % fällig am 07.03.2036		1.900		1.962
Europäische Investitionsbank 6,000 % fällig am 07.12.2028		1.700		1.877
Oracle Corp. 6,900 % fällig am 09.11.2052	$	1.900		1.639
United Kingdom Gilt 3,500 % fällig am 22.01.2045	£	1.900		1.635
Credit Agricole S.A. 4,875 % fällig am 23.10.2029		1.600		1.596
Stichting AK Rabobank Certificaten 6,500 % fällig am 29.12.2049	€	1.481		1.237
Virgin Money UK PLC 4,000 % fällig am 03.09.2027	£	1.235		1.108
MPT Operating Partnership LP 3,692 % fällig am 05.06.2028		1.400		1.039
Citigroup, Inc. 3,878 % fällig am 24.01.2039	$	1.500		1.006
MPT Operating Partnership LP 3,375 % fällig am 24.04.2030	£	1.600		1.004
Cooperatieve Rabobank UA 5,250 % fällig am 14.09.2027		1.050		995
CK Hutchison Group Telecom Finance S.A. 2,625 % fällig am 17.10.2034		1.350		916
NatWest Group PLC 2,057 % fällig am 09.11.2028		1.000		860

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Fondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

BESCHREIBUNG		AKTIEN		KOSTEN (000S)
KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2023				
PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)		44.264.451	$	440.792
		PAR (000S)		
U.S. Treasury Notes 3,500 % fällig am 31.01.2028	$	25.000		24.384
U.S. Treasury Notes 3,875 % fällig am 31.12.2027		10.000		10.149
Venture Global LNG, Inc. 8,375 % fällig am 01.06.2031		10.100		10.100
Trident TPI Holdings, Inc. 12,750 % fällig am 31.12.2028		9.750		9.647
Medline Borrower LP 5,250 % fällig am 01.10.2029		10.750		9.297
Grifols Escrow Issuer S.A. 4,750 % fällig am 15.10.2028		8.700		7.496
Burford Capital Global Finance LLC 9,250 % fällig am 01.07.2031		6.250		6.164
Venture Global LNG, Inc. 8,125 % fällig am 01.06.2028		6.000		6.000
American Airlines, Inc. 5,750 % fällig am 20.04.2029		5.700		5.441
Triumph Group, Inc. 9,000 % fällig am 15.03.2028		5.250		5.250
AMC Networks, Inc. 4,750 % fällig am 01.08.2025		5.700		5.248
Clarios Global LP 6,750 % fällig am 15.05.2028		5.000		5.000
Albertsons Cos., Inc. 6,500 % fällig am 15.02.2028		5.000		5.000
TransDigm, Inc. 6,750 % fällig am 15.08.2028		5.000		4.975
NGL Energy Operating LLC 7,500 % fällig am 01.02.2026		4.575		4.492
EQM Midstream Partners LP 4,500 % fällig am 15.01.2029		4.700		4.234
Transocean Titan Financing Ltd. 8,375 % fällig am 01.02.2028		4.000		4.000
Radiate Holdco LLC 4,500 % fällig am 15.09.2026		5.000		3.900
MajorDrive Holdings LLC 6,375 % fällig am 01.06.2029		4.800		3.808

BESCHREIBUNG		AKTIEN		ERLÖSE (000S)
VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2023				
PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)		41.382.866	$	412.100
		PAR (000S)		
U.S. Treasury Notes 4,250 % fällig am 15.10.2025	$	23.000		22.700
U.S. Treasury Notes 3,875 % fällig am 30.11.2027		15.700		15.734
U.S. Treasury Notes 3,500 % fällig am 15.09.2025		10.000		9.865
U.S. Treasury Notes 4,125 % fällig am 31.10.2027		9.000		9.006
Sprint Capital Corp. 8,750 % fällig am 15.03.2032		7.000		8.565
Heartland Dental LLC 8,500 % fällig am 01.05.2026		9.000		8.010
Global Medical Response, Inc. 6,500 % fällig am 01.10.2025		10.000		6.050
White Cap Buyer LLC 6,875 % fällig am 15.10.2028		6.800		6.001
Sprint Capital Corp. 6,875 % fällig am 15.11.2028		5.000		5.410
LBM Acquisition LLC 6,250 % fällig am 15.01.2029		6.725		5.274
Park River Holdings, Inc. 5,625 % fällig am 01.02.2029		7.000		5.140
Sprint LLC 7,625 % fällig am 15.02.2025		5.000		5.128
Alliant Holdings Intermediate LLC 6,750 % fällig am 15.10.2027		5.000		4.602
McAfee Corp. 7,375 % fällig am 15.02.2030		5.000		4.275
Occidental Petroleum Corp. 6,450 % fällig am 15.09.2036		4.000		4.072
Virgin Media Finance PLC 5,000 % fällig am 15.07.2030		5.000		3.968
Occidental Petroleum Corp. 5,500 % fällig am 01.12.2025		4.000		3.955
Park River Holdings, Inc. 6,750 % fällig am 01.08.2029		5.000		3.863
BCPE Ulysses Intermediate, Inc. 7,750 % fällig am 01.04.2027		5.000		3.856

(a) Der US High Yield Bond Fund legt in Anteile eines verbundenen Fonds an.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Fondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

BESCHREIBUNG		AKTIEN		KOSTEN (000S)
KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2023				
PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)		869.780	$	8.661
		PAR (000S)		
U.S. Treasury Notes 3,375 % fällig am 15.05.2033	$	7.700		7.473
U.S. Treasury Notes 4,125 % fällig am 15.11.2032		5.300		5.542
U.S. Treasury Bonds 4,000 % fällig am 15.11.2052		5.100		5.509
U.S. Treasury Notes 3,500 % fällig am 15.02.2033		4.400		4.452
U.S. Treasury Bonds 3,875 % fällig am 15.02.2043		4.400		4.416
U.S. Treasury Bonds 3,625 % fällig am 15.02.2053		3.800		3.722
Morgan Stanley 5,250 % fällig am 21.04.2034		3.600		3.600
Synchrony Financial 7,250 % fällig am 02.02.2033		3.600		3.587
Bank of America Corp. 5,288 % fällig am 25.04.2034		3.500		3.500
U.S. Treasury Inflation Protected Securities 1,500 % fällig am 15.02.2053 (b)		3.452		3.365
U.S. Treasury Bonds 4,000 % fällig am 15.11.2042		3.200		3.348
Amgen, Inc. 5,600 % fällig am 02.03.2043		3.075		3.066
Duke Energy Ohio, Inc. 5,650 % fällig am 01.04.2053		2.400		2.437
Apple, Inc. 4,850 % fällig am 10.05.2053		2.100		2.089
Venture Global Calcasieu Pass LLC 6,250 % fällig am 15.01.2030		2.000		2.000
Philip Morris International, Inc. 5,125 % fällig am 15.02.2030		2.000		1.984
Elevance Health, Inc. 4,750 % fällig am 15.02.2033		1.800		1.797
Wynn Resorts Finance LLC 7,125 % fällig am 15.02.2031		1.500		1.500
CVS Health Corp. 5,125 % fällig am 21.02.2030		1.500		1.490
UBS Group AG 5,959 % fällig am 12.01.2034		1.400		1.400
Southern California Gas Co. 5,200 % fällig am 01.06.2033		1.300		1.297
Pfizer Investment Enterprises Pte. Ltd. 5,340 % fällig am 19.05.2063		1.300		1.275
U.S. Treasury Bonds 3,875 % fällig am 15.05.2043		1.300		1.257

BESCHREIBUNG		PAR (000S)		ERLÖSE (000S)
VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2023				
U.S. Treasury Bonds 4,000 % fällig am 15.11.2042	$	6.200	$	6.249
U.S. Treasury Bonds 2,500 % fällig am 15.02.2045		7.300		5.736
U.S. Treasury Notes 4,125 % fällig am 15.11.2032		5.300		5.559
U.S. Treasury Bonds 4,000 % fällig am 15.11.2052		5.100		5.230
		AKTIEN		
PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)		381.593		3.800
		PAR (000S)		
U.S. Treasury Bonds 3,625 % fällig am 15.02.2053	$	3.800		3.634
U.S. Treasury Notes 2,875 % fällig am 15.05.2032		2.900		2.760
U.S. Treasury Bonds 3,250 % fällig am 15.05.2042		2.764		2.518
U.S. Treasury Bonds 3,375 % fällig am 15.08.2042		2.800		2.490
Vonovia SE 0,000 % fällig am 01.12.2025	€	2.300		2.175
U.S. Treasury Bonds 2,875 % fällig am 15.05.2052	$	2.600		2.154
Synchrony Financial 7,250 % fällig am 02.02.2033		2.400		2.127
RegionalCare Hospital Partners Holdings, Inc. 9,023 % fällig am 16.11.2025		2.006		1.954
DaVita, Inc. 4,625 % fällig am 01.06.2030		2.200		1.829
Elanco Animal Health, Inc. 1,000 % fällig am 01.08.2027		1.543		1.520
Wynn Resorts Finance LLC 7,125 % fällig am 15.02.2031		1.500		1.493
U.S. Treasury Bonds 3,875 % fällig am 15.05.2043		1.300		1.268
DAE Funding LLC 1,625 % fällig am 15.02.2024		1.250		1.198
Nationstar Mortgage Holdings, Inc. 5,500 % fällig am 15.08.2028		1.188		1.002
JPMorgan Chase & Co. 4,851 % fällig am 25.07.2028		1.000		1.001
Citizens Bank N.A. 4,575 % fällig am 09.08.2028		1.000		977
Aroundtown S.A. 5,375 % fällig am 21.03.2029		1.200		947
Lloyds Banking Group PLC 4,716 % fällig am 11.08.2026		900		888
Freedom Mortgage Corp. 8,125 % fällig am 15.11.2024		900		868
Lloyds Banking Group PLC 4,976 % fällig am 11.08.2033		900		859
U.S. Treasury Bonds 3,875 % fällig am 15.02.2043		800		783
UDR, Inc. 3,000 % fällig am 15.08.2031		900		771
Lloyds Banking Group PLC 4,375 % fällig am 22.03.2028		800		759
Barclays PLC 8,000 % fällig am 15.03.2029		800		707

(a) Der US Investment Grade Corporate Bond Fund legt in Anteile eines verbundenen Fonds an.

(b) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Fondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

BESCHREIBUNG		PAR (000S)	KOSTEN (000S)
KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2023			
U.S. Treasury Notes 3,500 % fällig am 31.01.2028	$	71.500	$ 71.193
Federal Home Loan Bank 5,500 % fällig am 08.05.2025		38.000	38.000
Freddie Mac 5,950 % fällig am 21.03.2025		33.000	33.000
Freddie Mac 5,550 % fällig am 09.05.2025		25.000	25.000
Federal Home Loan Bank 5,480 % fällig am 26.02.2025		22.400	22.400
Freddie Mac 5,520 % fällig am 28.05.2025		22.400	22.400
Freddie Mac 5,820 % fällig am 20.03.2025		21.000	21.000
Freddie Mac 5,680 % fällig am 03.04.2025		21.000	21.000
Freddie Mac 5,730 % fällig am 03.04.2025		21.000	21.000
Federal Home Loan Bank 5,650 % fällig am 28.05.2025		21.000	21.000
Morgan Stanley 0,790 % fällig am 30.05.2025		21.500	20.390
Neuberger Berman Loan Advisers CLO Ltd. 6,395 % fällig am 19.10.2031		20.250	20.136
Federal Home Loan Bank 5,710 % fällig am 14.03.2025		20.000	20.000
Freddie Mac 5,800 % fällig am 03.07.2025		20.000	20.000
Athene Global Funding 5,790 % fällig am 24.05.2024		14.200	14.073
HCA, Inc. 5,000 % fällig am 15.03.2024		14.000	13.906
CIFC Funding Ltd. 6,323 % fällig am 24.04.2030		13.891	13.791
Westpac Banking Corp. 4,862 % fällig am 16.11.2023	AUD	20.000	13.782
Goldman Sachs Group, Inc. 1,757 % fällig am 24.01.2025	$	13.100	12.714
Barclays PLC 3,932 % fällig am 07.05.2025		12.800	12.522
Bank of America Corp. 0,976 % fällig am 22.04.2025		12.500	11.926
Boeing Co. 1,433 % fällig am 04.02.2024		10.900	10.557
Freddie Mac 5,375 % fällig am 24.04.2025		10.000	10.000
Warnermedia Holdings, Inc. 3,428 % fällig am 15.03.2024		10.125	9.921
JPMorgan Chase & Co. 4,023 % fällig am 05.12.2024		10.000	9.877
AerCap Ireland Capital DAC 1,150 % fällig am 29.10.2023		10.000	9.752
Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc. 6,439 % fällig am 13.01.2026		9.700	9.700
Morgan Stanley 3,737 % fällig am 24.04.2024		9.350	9.323
CNH Industrial Capital LLC 4,200 % fällig am 15.01.2024		9.000	8.924
Bayer U.S. Finance LLC 3,875 % fällig am 15.12.2023		8.479	8.391

BESCHREIBUNG		PAR (000S)	ERLÖSE (000S)
VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2023			
U.S. Treasury Notes 3,500 % fällig am 31.01.2028	$	71.500	$ 71.556
U.S. Treasury Notes 3,500 % fällig am 15.09.2025		63.700	62.354
Federal Home Loan Bank 1,115 % fällig am 26.02.2027		31.500	27.837
Federal Home Loan Bank 0,900 % fällig am 26.02.2027		26.500	22.994
Ginnie Mae 3,000 % fällig am 20.07.2051		25.968	22.345
Ginnie Mae 3,000 % fällig am 20.06.2051		22.856	19.763
		AKTIEN	
PIMCO ETFs plc - PIMCO US Dollar Short Maturity UCITS ETF (a)		198.700	19.741
		PAR (000S)	
Internationale Bank für Wiederaufbau und Entwicklung 0,850 % fällig am 10.02.2027	$	18.800	16.711
Bayer U.S. Finance LLC 3,875 % fällig am 15.12.2023		15.979	15.819
Danske Bank A/S 5,375 % fällig am 12.01.2024		14.850	14.765
Wells Fargo & Co. 6,372 % fällig am 25.04.2026		14.500	14.617
BAT Capital Corp. 3,222 % fällig am 15.08.2024		14.750	14.315
AerCap Ireland Capital DAC 1,150 % fällig am 29.10.2023		12.950	12.734
Santander UK Group Holdings PLC 1,089 % fällig am 15.03.2025		12.800	12.249
Eni SpA 4,000 % fällig am 12.09.2023		11.800	11.743
Ginnie Mae 2,500 % fällig am 20.06.2051		13.399	11.253
AerCap Ireland Capital DAC 4,500 % fällig am 15.09.2023		10.000	9.940
Credit Agricole S.A. 6,570 % fällig am 22.03.2024		9.400	9.439
Bank of America Corp. 5,791 % fällig am 24.10.2024		7.500	7.502
BPCE S.A. 4,000 % fällig am 15.04.2024		7.500	7.385
BNP Paribas S.A. 3,800 % fällig am 10.01.2024		7.280	7.195
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A. 0,875 % fällig am 18.09.2023		7.200	7.106
Goldman Sachs Group, Inc. 0,925 % fällig am 21.10.2024		6.700	6.546
Nordea Bank Abp 6,403 % fällig am 30.08.2023		6.000	6.007
7-Eleven, Inc. 0,800 % fällig am 10.02.2024		6.000	5.779

(a) Der US Short-Term Fund legt in Anteile eines verbundenen Fonds an.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Fondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, und bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere, die während des Berichtszeitraums fällig wurden, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

Glossar: (möglicherweise im vorstehenden Abschluss verwendete Abkürzungen)

Abkürzungen der Kontrahenten:

AZD	Australia and New Zealand Banking Group	**DUB**	Deutsche Bank AG	**MSC**	Morgan Stanley & Co. LLC.
BOA	Bank of America N.A.	**FAR**	Wells Fargo Bank National Association	**MYC**	Morgan Stanley Capital Services LLC
BOM	Bank of Montreal	**FBF**	Credit Suisse International	**MYI**	Morgan Stanley & Co. International PLC
BOS	BofA Securities, Inc.	**FCT**	Credit Suisse Capital LLC	**NOM**	Nomura Securities International, Inc.
BPG	BNP Paribas Securities Corp.	**FICC**	Fixed Income Clearing Corporation	**NXN**	Natixis New York
BPS	BNP Paribas S.A.	**GLM**	Goldman Sachs Bank USA	**PER**	Pershing LLC
BRC	Barclays Bank PLC	**GRE**	NatWest Markets Securities, Inc.	**RBC**	Royal Bank of Canada
				RCY	Royal Bank of Canada
BSH	Banco Santander S.A. - New York Branch	**GSC**	Goldman Sachs & Co. LLC	**RDR**	RBC Capital Markets LLC
BSN	The Bank of Nova Scotia - Toronto	**GST**	Goldman Sachs International	**RVM**	Barclays Capital, Inc.
BSS	Banco Santander S.A.	**HUS**	HSBC Bank USA N.A.	**RYL**	NatWest Markets Plc
BYL	Barclays Bank PLC Niederlassung London	**IND**	Crédit Agricole Corporate and Investment Bank S.A.	**SAL**	Citigroup Global Markets, Inc.
BYR	The Bank of Nova Scotia - Toronto				
CBK	Citibank N.A.	**JLN**	JP Morgan Chase Bank N.A. London	**SCX**	Standard Chartered Bank, London
CDI	Natixis Singapore	**JML**	JP Morgan Securities Plc	**SOG**	Societe Generale Paris
CIB	Canadian Imperial Bank of Commerce	**JPM**	JP Morgan Chase Bank N.A.	**SSB**	State Street Bank and Trust Co.
CKL	Citibank N.A. London	**JPS**	J.P. Morgan Securities LLC	**TDM**	TD Securities (USA) LLC
CLY	Crédit Agricole Corporate and Investment Bank	**MAC**	Macquarie Bank Limited	**TOR**	The Toronto-Dominion Bank
COM	Commerz Bank AG	**MBC**	HSBC Bank Plc	**UAG**	UBS AG Stamford
CSN	Credit Suisse AG (New York)	**MEI**	Merrill Lynch International	**UBS**	UBS Securities LLC
DBL	Deutsche Bank AG London	**MFK**	Barclays Capital, Inc.		
DEU	Deutsche Bank Securities, Inc.				

Währungskürzel:

AED	Dirham der Vereinigten Arabischen Emirate	**GHS**	Ghanaischer Cedi	**PHP**	Philippinischer Peso
ARS	Argentinischer Peso	**HKD**	Hongkong-Dollar	**PLN**	Polnischer Zloty
AUD	Australischer Dollar	**HUF**	Ungarischer Forint	**RON**	Rumänischer neuer Leu
BRL	Brasilianischer Real	**IDR**	Indonesische Rupie	**RSD**	Serbischer Dinar
CAD	Kanadischer Dollar	**ILS**	Israelischer Shekel	**RUB**	Russischer Rubel
CHF	Schweizer Franken	**INR**	Indische Rupie	**SEK**	Schwedische Krone
CLP	Chilenischer Peso	**JPY (oder ¥)**	Japanischer Yen	**SGD**	Singapur-Dollar
CNH	Chinese Renminbi (Offshore)	**KES**	Kenia-Schilling	**THB**	Thailändischer Baht
CNY	Chinese Renminbi (Mainland)	**KRW**	Südkoreanischer Won	**TRY**	Türkische neue Lira
COP	Kolumbianischer Peso	**KZT**	Kasachischer Tenge	**TWD**	Taiwanesischer Dollar
CZK	Tschechische Krone	**MXN**	Mexikanischer Peso	**UGX**	Uganda-Schilling
DKK	Dänische Krone	**MYR**	Malaysischer Ringgit	**USD (oder $)**	US-Dollar
DOP	Dominikanischer Peso	**NGN**	Nigerianische Naira	**UYU**	Uruguayischer Peso
EGP	Ägyptisches Pfund	**NOK**	Norwegische Krone	**VND**	Vietnamesischer Dong
EUR (oder €)	Euro	**NZD**	Neuseeländischer Dollar	**ZAR**	Südafrikanischer Rand
GBP (oder £)	Britisches Pfund	**PEN**	Peruanischer neuer Sol	**ZMW**	Sambischer Kwacha

Börsenkürzel:

BIST	Borsa Instanbul Exchange	**CME**	Chicago Mercantile Exchange	**OTC**	Over the Counter
CBOT	Chicago Board of Trade	**FTSE**	Financial Times Stock Exchange		

Index-/Spread-Kürzel:

ABX.HE	Asset-Backed Securities Index - Home Equity	**CPTFEMU**	Eurozone HICP ex-Tobacco Index	**NDUEACWF**	MSCI ACWI Index Future
ACS	Algonquin Cityfates Natural Gas Basis Futures Index	**CPURNSA**	Consumer Price All Urban Non-Seasonally Adjusted Index	**NDUEEGF**	iShares MSCI Emerging Markets ETF
AMZX	Alerian MLP Total Return Index	**DAX**	Deutscher Aktien Index 30	**OMXS30**	Stockholm 30 Index
BCOMF1TC	Bloomberg Commodity Index 1-Month Forward Total Return	**DWRTFT**	Dow Jones Wilshire REIT Total Return Index	**PIMCODBU**	PIMCO Custom Commodity Basket
BCOMTR	Bloomberg Commodity Index Total Return	**FRCPXTOB**	Französischer Verbraucherpreisindex ohne Tabak	**PrimeX.ARM**	Prime Mortgage-Backed Securities Index - Adjustable Rate Mortgage
BCOMTR1	Bloomberg Custom Commodity Index	**FTSE/JSE**	South African Performance Index	**S&P 500**	Standard & Poor's 500 Index
BOVESPA	Brazil Bovespa Index	**FTSE/MIB**	Index der 40 italienischen Aktien mit der höchsten Liquidität/Marktkapitalisierung der Borsa Italiana	**S&P CNX Nifty**	Standard & Poor's Nifty 50 Index
CAC	Cotation Assistée en Continu	**IBEX 35**	Spanish Continuous Exchange Index	**SIBCSORA**	Singapore Overnight Rate Average
CAONREPO	Canadian Overnight Repo Rate Average	**IBR**	Indicador Bancario de Referencia	**SONIO**	Sterling Overnight Interbank Average Rate
CDX.EM	Credit Derivatives Index — Emerging Markets	**IXITR**	S&P's Industrials Select Sector Index	**SPI 200**	Australian Equity Futures Index
CDX.HY	Credit Derivatives Index - High Yield	**JMABDEWU**	J.P. Morgan Custom Commodity Index	**SRFXON3**	Swiss Overnight Rate Average (6PM)
CDX.IG	Credit Derivatives Index – Investment Grade	**JMABNIU5**	J.P. Morgan Custom Commodity Index	**TOPIX**	Tokyo Price Index
CIXBSTR3	Individuell zusammengestellter Rohstoffindex	**KOSPI**	Korea Composite Stock Price Index	**TRNGLU**	FTSE EPRA/NAREIT Developed Index Net TRI USD
CMBX	Commercial Mortgage-Backed Index	**KOSPI2**	Korea Stock Exchange KOSPI 200 Index	**UKRPI**	United Kingdom Retail Prices Index
CNREPOFIX	China Fixing Repo Rates 7-Day	**MUTKCALM**	Tokyo Overnight Average Rate	**VSTOXX**	Euro Stoxx 50 Volatility Index
CPALEMU	Euro Area All Items Non-Seasonally Adjusted Index	**NASDAQ**	National Asscociation of Securities Dealers Automated Quotations	**WIG20**	Nach Marktkapitalisierung gewichteter Börsenindex der 20 größten Unternehmen an der Warschauer Börse

Kommunalanleihen- oder Behördenkürzel:

AGM	Assured Guaranty Municipal	**ST**	State

Sonstige Kürzel:

ABS	Asset-Backed Security (forderungsbesichertes Wertpapier)	**EURIBOR**	Euro Interbank Offered Rate	**PRIBOR**	Prague Interbank Offered Rate
ALT	Alternate Loan Trust	**HIBOR**	Hong Kong Interbank Offered Rate	**REIT**	Real Estate Investment Trust (Immobilieninvestmentfonds)
BABs	Build America Bonds	**JIBAR**	Johannesburg Interbank Agreed Rate	**REMIC**	Real Estate Mortgage Investment Conduit
BBR	Bank Bill Rate	**JSC**	Joint Stock Company	**RMBS**	Residential Mortgage-Backed Security
BBSW	Bank Bill Swap Reference Rate	**KLIBOR**	Kuala Lumpur Interbank Offered Rate	**STIBOR**	Stockholm Interbank Offered Rate
BRL-CDI	Brazil Interbank Deposit Rate	**KORIBOR**	Korea Interbank Offered Rate	**TAIBOR**	Taipei Interbank Offered Rate
BTP	Buoni del Tesoro Poliennali “Long-term Treasury Bond”	**LIBOR**	London Interbank Offered Rate	**TBA**	To-Be-Announced
CBO	Collateralised Bond Obligation	**MIBOR**	Mumbai Interbank Offered Rate	**TBD**	To-Be-Determined
CDO	Collateralised Debt Obligation (besicherte Schuldverschreibungen)	**MSCI**	Morgan Stanley Capital International	**TBD%**	Bei Abrechnung des Darlehens oder zum Zeitpunkt der Finanzierung zu ermittelnder Zinssatz
CHILIBOR	Chile Interbank Offered Rate	**NIBOR**	Norwegian Interbank Offered Rate	**TELBOR**	Tel Aviv Inter-Bank Offered Rate
CLO	Collateralised Loan Obligation (durch Kreditportfolio besicherte Wertpapiere)				
CMBS	Collateralised Mortgage-Backed Security	**OAT**	Obligations Assimilables du Trésor	**THB-THORON**	Thai Overnight Repurchase Rate
DAC	Designated Activity Company	**OIS**	Overnight Index Swap	**TIIE**	Tasa de Interés Interbancaria de Equilibrio „Gleichgewichtszinssatz im Interbankengeschäft“
EUR-ESTRON	Euro Short-Term Rate	**PIK**	Payment-in-Kind (Sachausschüttung)	**WIBOR**	Warsaw Interbank Offered Rate

Allgemeine Informationen

VERWALTUNGSGESELLSCHAFT
PIMCO Global Advisors (Ireland) Limited,
Third Floor,
Harcourt Building,
Harcourt Street,
Dublin,
D02 F721,
Irland.

ANLAGEBERATUNGSGESELLSCHAFT
Pacific Investment Management
Company LLC,
650 Newport Center Drive,
Newport Beach, California 92660,
USA.

PIMCO Europe Ltd.,
11 Baker Street,
London W1U 3AH,
Großbritannien.

PIMCO Asia Pte Ltd.,
8 Marina View, #30-01,
Asia Square Tower 1,
Singapur 018960.

PIMCO Europe GmbH,
Seidlstraße 24-24a,
80335 München
Deutschland.

ADMINISTRATOR
State Street Fund Services (Ireland) Limited,
78 Sir John Rogerson's Quay,
Dublin 2,
D02 HD32,
Irland.

VERWAHRSTELLE
State Street Custodial Services (Ireland)
Limited,
78 Sir John Rogerson's Quay,
Dublin 2,
D02 HD32,
Irland.

VERTRIEBSSTELLEN
PIMCO Europe GmbH,
Seidlstraße 24-24a,
80335 München
Deutschland.

PIMCO Europe Ltd.,
11 Baker Street,
London W1U 3AH,
Großbritannien.

PIMCO Asia Pte Ltd.,
8 Marina View, #30-01,
Asia Square Tower 1,
Singapur 018960.

PIMCO Asia Limited,
22nd Floor, Suite 2201,
Two International Finance Centre,
8 Finance Street, Central,
Hongkong.

PIMCO Australia Pty Ltd.,
Level 19, 5 Martin Place,
363 George Street,
Sydney, New South Wales 2000,
Australien.

ÖSTERREICHISCHE ZAHLSTELLE
UniCredit Bank Austria AG,
Schottengasse 6-8,
1010 Wien,
Österreich.

REPRÄSENTANT IN SINGAPUR
PIMCO Asia Pte Ltd.,
8 Marina View, #30-01,
Asia Square Tower 1,
Singapur 018960.

ITALIENISCHE KORRESPONDENZBANKEN
Allianz Bank Financial Advisors S.p.A.,
Piazza Velasca, 7/9,
20122 Mailand,
Italien.

State Street Bank International GmbH
– Succursale Italia,
Via Ferrante Aporti, 10,
Mailand,
Italien.

Société Générale Securities Services
S.p.A. („SGSS"),
Via Santa Chiara, 19,
Turin,
Italien.

AllFunds Bank S.A.U.,
Succursale di Milano,
Via Bocchetto, 6,
20123 Mailand,
Italien.

Banca Sella Holding S.p.A.,
Piazza Gaudenzio Sella, 1,
13900 Biella,
Italien.

Monte dei Paschi di Siena S.p.A.,
Via Verii, 14,
Mantua,
Italien.

RBC Investor Services Bank S.A.,
Niederlassung Mailand,
Via Vittor Pisani, 26,
20124 Mailand,
Italien.

CACEIS Bank, Niederlassung Italien,
Piazza Cavour 2,
20121 Mailand,
Italien.

REPRÄSENTANT IN HONGKONG
PIMCO Asia Limited,
22nd Floor, Suite 2201,
Two International Finance Centre,
8 Finance Street,
Hongkong.

LUXEMBURGER ZAHLSTELLE UND VERTRETUNGSSTELLE
Société Générale Luxembourg,
(Centre Opérationel/FED),
28-32, Place de la Gare,
L-1616, Luxemburg.

SCHWEIZER ZAHLSTELLE UND REPRÄSENTANZ
BNP PARIBAS Paris,
Niederlassung Zürich,
Selnaustrasse 16,
8002 Zürich,
Schweiz.

BRITISCHER REPRÄSENTANT
PIMCO Europe Ltd.,
11 Baker Street,
London W1U 3AH,
Großbritannien.

BELGISCHE ZAHLSTELLE
ABN AMRO BANK S.A.,
Borsbeeksebrug 30,
2600 Antwerpen,
Belgien.

DEUTSCHE ZAHL- UND INFORMATIONSSTELLE
Marcard, Stein & Co AG,
Ballindamm 36,
20095 Hamburg,
Deutschland.

PORTUGIESISCHE ZAHLSTELLE
Banco Activobank (Portugal) S.A.,
Rua Augusta 86,
1149-023, Lissabon,
Portugal.

SCHWEDISCHE ZAHLSTELLE
SEB Merchant Banking,
SE-106 40,
Stockholm,
Schweden.

GRIECHISCHE ZAHLSTELLE
Eurobank Asset Management M.F.M.C.,
10 Stadiou Street,
GR 10564 Athen,
Griechenland.

UNGARISCHE ZAHLSTELLE
European Investment Centre,
Tomasikova 64,
831 04 Bratislava,
Slowakische Republik.

ZAHLSTELLE IN DER TSCHECHISCHEN REPUBLIK
European Investment Centre,
Veveří 2581/102,
616 00 Brno,
Tschechische Republik.

FRANZÖSISCHE ZENTRALISIERUNGS- UND FINANZSTELLE
Société Générale,
29, Boulevard Haussmann,
75009 Paris,
Frankreich.

ZAHLSTELLE IN LIECHTENSTEIN
LGT Bank Ltd.,
Herrengasse 12,
FL-9490 Vaduz,
Liechtenstein.

ZAHLSTELLE AUF ZYPERN
EUROBANK CYPRUS LTD.,
28, Spyrou Kyprianou Avenue,
1075 Nikosia,
Zypern.

RECHTSBERATER FÜR IRISCHES RECHT
Dillon Eustace LLP,
33 Sir John Rogerson's Quay,
Dublin 2,
D02 XK09,
Irland.

RECHTSBERATER FÜR US-RECHT
Dechert LLP,
1900 K Street N.W.,
Washington, D.C. 20006,
USA.

UNABHÄNGIGE ABSCHLUSSPRÜFER
PricewaterhouseCoopers
Chartered Accountants und Statutory
Audit Firm,
One Spencer Dock,
North Wall Quay,
Dublin 1,
D01 X9R7,
Irland.

SEKRETÄR
(bis zum 25. Januar 2023)
State Street Fund Services (Ireland) Limited,
78 Sir John Rogerson's Quay,
Dublin 2,
D02 HD32,
Irland.

(mit Wirkung zum 26. Januar 2023)
Walkers Corporate Services (Ireland) Limited,
The Exchange,
George's Dock,
Dublin D01 P2V6,
Irland.

BETREUENDER MAKLER
Dillon Eustace LLP,
33 Sir John Rogerson's Quay,
Dublin 2,
D02 XK09,
Irland.

EINGETRAGENER GESCHÄFTSSITZ
PIMCO Funds: Global Investors
Series plc,
78 Sir John Rogerson's Quay,
Dublin 2,
D02 HD32,
Irland.

VERWALTUNGSRAT DER GESELLSCHAFT UND VERWALTUNGSGESELLSCHAFT
V. Mangala Ananthanarayanan[1] (Indien)
Ryan P. Blute[1] (USA)
John Bruton (unabhängiges Verwaltungsratsmitglied) (Irland)
Craig A. Dawson[1] (USA)
David M. Kennedy (unabhängiges Verwaltungsratsmitglied) (Irland)
Frances Ruane (unabhängiges Verwaltungsratsmitglied) (Irland)

Der Prospekt, Prospektergänzungen, die Gründungsurkunde und Satzung, die wesentlichen Anlegerinformationen sowie Jahres- und Halbjahresberichte können kostenlos beim Repräsentanten oder Agenten eines jeden Rechtsraums bezogen werden.
Eine Kopie der Liste der Portfolioveränderungen in dem am 30. Juni 2023 abgelaufenen Berichtszeitraum kann von den Anteilinhabern kostenlos bei der Verwahrstelle oder den Zahlstellen sowie bei der Zahl- und Informationsstelle in Deutschland und der Vertretungsstelle in der Schweiz bezogen werden.

[1] Mitarbeiter von PIMCO.

PIMCO Europe Ltd (Registernummer 2604517) wurde von der Financial Conduct Authority (12 Endeavour Square, London, E20 1JN) im Vereinigten Königreich zugelassen und steht unter deren Aufsicht. Die von PIMCO Europe Ltd erbrachten Dienstleistungen sind nicht für Kleinanleger verfügbar, die sich nicht auf diese Unterlagen verlassen, sondern ihren Finanzberater kontaktieren sollten.

PIMCO Europe GmbH (Registernummer 192083, Seidlstr. 24-24a, 80335 München, Deutschland), PIMCO Europe GmbH Niederlassung Italien (Registernummer 10005170963), PIMCO Europe GmbH Niederlassung Irland (Registernummer 909462), PIMCO Europe GmbH Niederlassung Vereinigtes Königreich (Registernummer 2604517) und PIMCO Europe GmbH Niederlassung Spanien (N.I.F. W2765338E) sind von der Bundesanstalt für Finanzdienstleistungsaufsicht (BaFin) (Marie-Curie-Str. 24-28, 60439 Frankfurt am Main) in Deutschland zugelassen und werden von dieser gemäß § 15 des Wertpapierinstitutsgesetz (WpIG) reguliert. Die Niederlassungen Italien, Irland, Vereinigtes Königreich und Spanien werden zusätzlich beaufsichtigt von: (1) Niederlassung Italien: Die Commissione Nazionale per le Società e la Borsa (CONSOB) gemäß Artikel 27 des italienischen Einheitsgesetzes über die Finanzvermittlung; (2) Niederlassung Irland: Die Zentralbank von Irland gemäß Verordnung 43 der EU-Verordnungen (Märkte für Finanzinstrumente) von 2017 in der jeweils gültigen Fassung; (3) Niederlassung Vereinigtes Königreich: die Financial Conduct Authority und (4) Niederlassung Spanien: der Comisión Nacional del Mercado de Valores (CNMV) gemäß den Verpflichtungen der Artikel 168 und 203 bis 224 sowie den Verpflichtungen aus Abschnitt V, Abschnitt I des Gesetzes über den Wertpapiermarkt (LSM) und den Artikeln 111, 114 und 117 des Königlichen Dekrets 217/2008. Die von PIMCO Europe GmbH erbrachten Dienstleistungen stehen nur professionellen Kunden im Sinne von § 67 Abs. 2 WpHG (Wertpapierhandelsgesetz) zur Verfügung. Sie sind nicht für Privatanleger verfügbar, die sich nicht auf diese Unterlagen verlassen sollten.

PIMCO (Schweiz) GmbH (eingetragen in der Schweiz, Registernummer CH-020.4.038.582-2). Die von PIMCO (Schweiz) GmbH erbrachten Dienstleistungen sind nicht für Kleinanleger verfügbar, die sich nicht auf diese Unterlagen verlassen, sondern ihren Finanzberater kontaktieren sollten.